

**DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN**

Fondo Banorte 21, S.A. de C.V. F.I.I.D. administrado por Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, GFB

|                               |  |                                  |                             |                                       |
|-------------------------------|--|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------------|
| <b>Tipo:</b>                  | INSTRUMENTOS DE DEUDA  | <b>Serie B, Clase Accionaria</b> | <b>Posibles Adquirentes</b> | <b>Monto Mínimo de Inversión (\$)</b> |
| <b>Categoría:</b>             | CORTO PLAZO MONEDA EXTRANJERA (IDCPME)                             | F1                               | PERSONAS FÍSICAS            | Sin monto mínimo de inversión         |
| <b>Clave de Pizarra:</b>      | NTEEURO  |                                  |                             |                                       |
| <b>Calificación:</b>          | AAAf/S5(mex)<br>Escala de calificación de Calificadora y homogénea |                                  |                             |                                       |
| <b>Fecha de Autorización:</b> | 12 enero 2024 No. Oficio 157/026/2024                              |                                  |                             |                                       |

**Importante:** El valor de un Fondo de Inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de Inversión**

El objetivo fundamental de NTEEURO será ofrecer un portafolio conformado primordialmente por activos objeto de inversión de deuda, Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda, Exchange Traded Funds (ETF'S) y/o Trackers denominados, indizados y/o referenciados al Euro, complementando la inversión con otros activos de deuda en moneda nacional. Dichos activos podrán estar emitidos en el mercado local o en mercados internacionales, de corto plazo principalmente, y de mediano y largo plazo en menor medida.

NTEEURO está orientado a pequeños, medianos y grandes inversionistas, personas físicas, personas morales, personas no sujetas a retención y/o Fondos de Inversión (considerando su nivel de complejidad o sofisticación) que busquen un nivel moderado a alto de riesgo y alta liquidez en función del objetivo, estrategia y calificación del Fondo.

El horizonte de inversión para el inversionista que compra acciones de NTEEURO es de corto plazo, por lo que se sugiere permanecer en el Fondo por lo menos un año para obtener los beneficios de la estrategia.

**Información Relevante**

Los Fondos de Inversión no cuentan con Asamblea de Accionistas, Consejo de Administración o Comisario:

- Las funciones de la Asamblea de Accionistas, así como las actividades del Consejo de Administración están encomendadas a Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte.
- La vigilancia del Fondo está asignada al Contralor Normativo de la Sociedad Operadora.

**Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos:** 2.58%, con un nivel de confianza del 95% a dos colas.

La pérdida máxima que en un escenario pesimista (3 en 100 veces) puede enfrentar el Fondo en un lapso de 1 día es de \$25.80 pesos por cada \$1,000 pesos invertidos. (Este dato es solo una estimación, y es válida únicamente en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

Se entiende por VaR a la pérdida máxima potencial en condiciones normales de mercado que pueden tener los activos netos de un Fondo de Inversión, calculada con un horizonte de tiempo de 1 día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones históricas en los factores de riesgo.

**Desempeño Histórico**

|             |  |
|-------------|--|
| Clase<br>F1 | <b>Índice de Referencia:</b> Tipo de Cambio del EURO (Valmer). |
|-------------|--|

**Tabla de Rendimientos nominales anualizados**

|                                 | Último Mes | Últimos 3 Meses | Últimos 12 Meses | Mes Rto. Bajo | Mes Rto. Alto |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|---------------|
| RENDIMIENTO BRUTO               | -29.24 %   | -16.65 %        | -8.48 %          | -46.09 %      | 52.16 %       |
| RENDIMIENTO NETO                | -30.29 %   | -17.89 %        | -9.58 %          | -46.63 %      | 50.65 %       |
| TASA LIBRE DE RIESGO (CETES 28) | 11.03 %    | 11.13 %         | 11.15 %          | 10.91 %       | 11.32 %       |
| ÍNDICE DE REFERENCIA            | -36.04 %   | -15.51 %        | -8.56 %          | -51.82 %      | 38.16 %       |

- El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.
- La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones o cualquier otro gasto.
- El desempeño del Fondo de Inversión en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá la inversión en el futuro.

**Régimen y Política de Inversión**

a) Estrategia de Inversión: Activa.

b) Montos máximos o mínimos de inversión de los principales activos objeto de inversión del Fondo:

|  | Mín | Máx  |
|--|-----|------|
| Activos objeto de inversión de deuda denominados, indizados y/o referenciados al Euro.   | 95% | 100% |
| Mecanismos de inversión colectiva ETFs denominados, indizados y/o referenciados al Euro. |     | 100% |
| Reportos.  |     | 100% |
| Valores de deuda en moneda nacional.   |     | 5%   |
| Valores de fácil realización y/o con vencimiento menor a 3 meses.                        | 20% | 100% |

c) Política de inversión: El Fondo podrá invertir en el mercado nacional y en mercados internacionales.

d) NTEEURO buscará proporcionar, antes de gastos totales e impuestos, un rendimiento similar al tipo de cambio del EURO. Este índice será dado a conocer en [www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio](http://www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio).

e) NTEEURO podrá invertir hasta un 100% de su activo neto en activos emitidos, avalados o aceptados por instituciones de crédito que formen parte del mismo Consorcio o Grupo empresarial al que pertenezca su Operadora de acuerdo al régimen de inversión, cumpliendo con lo establecido en el artículo 6 fracción I de la CUFÍ.

f) NTEEURO podrá realizar operaciones de préstamo de valores, con un plazo máximo de 1 año, con prórrogas por igual periodo.

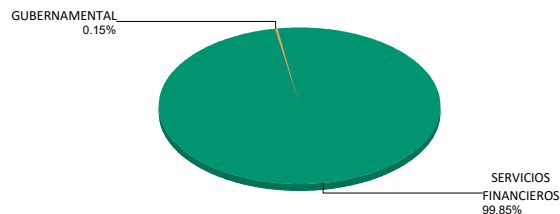
g) NTEEURO no invertirá en instrumentos financieros derivados, valores estructurados ni en valores respaldados por activos. NTEEURO podrá invertir en certificados bursátiles fiduciarios indizados, ETF's y/o en Trackers listados en el SIC y/o en otros mercados.

**Composición de la Cartera de Inversión**

Principales inversiones al mes de marzo 2024

| Clave de Pizarra     | Activo Objeto de Inversión |                   |          | Monto Miles de \$ | %           |
|----------------------|----------------------------|-------------------|----------|-------------------|-------------|
|                      | Emisora                    | Nombre/Subyacente | Tipo     |                   |             |
| 140-012 2742284      | Chequera Euros             | N/A               | CHEQUERA | 115,256           | 99.83%      |
| 2BPAG91 250102       | BONOS Prot Ahorro          | N/A               | REPORTO  | 178               | 0.15%       |
| 340-012 2742136      | Chequera Pesos             | N/A               | CHEQUERA | 15                | 0.01%       |
| 4                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 5                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 6                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 7                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 8                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 9                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 10                   |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| <b>Cartera Total</b> |                            |                   |          | <b>115,449</b>    | <b>100%</b> |

**Por Sector de Actividad Económica**



**Comisiones y Remuneraciones por la Prestación de Servicios**
**Pagadas por el cliente**

| Concepto                                   | Clase F1   |            | Clase más representativa (F1) |            |
|--|------------|------------|-------------------------------|------------|
|  | %          | \$         | %                             | \$         |
| INCUMPLIMIENTO PLAZO MÍNIMO DE PERMANENCIA | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| INCUMPLIMIENTO SALDO MÍNIMO DE INVERSIÓN   | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| COMPRA DE ACCIONES                         | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| VENTA DE ACCIONES                          | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIOS POR ASESORÍA                     | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIO ADMINISTRACIÓN DE ACCIONES        | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| OTRAS                                      | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| <b>Total</b>                               | <b>n/a</b> | <b>n/a</b> | <b>n/a</b>                    | <b>n/a</b> |

No aplica para ninguna clase accionaria.

**Pagadas por el Fondo de Inversión**

(cifras correspondientes al mes de marzo 2024)

| Concepto                                | Clase F1     |              | Clase más representativa (F1) |              |
|---|--------------|--------------|-------------------------------|--------------|
|   | %            | \$           | %                             | \$           |
| ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS               | 0.345        | 3.45         | 0.345                         | 3.45         |
| ADMINISTRACIÓN ACTIVOS S/ DESEMPEÑO     | n/a          | n/a          | n/a                           | n/a          |
| DISTRIBUCIÓN DE ACCIONES                | 0.805        | 8.05         | 0.805                         | 8.05         |
| VALUACIÓN DE ACCIONES                   | 0.043        | 0.43         | 0.043                         | 0.43         |
| DEPÓSITO DE ACCIONES DEL FI             | 0.000        | 0.00         | 0.000                         | 0.00         |
| DEPÓSITO DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN | 0.000        | 0.00         | 0.000                         | 0.00         |
| CONTABILIDAD                            | 0.080        | 0.80         | 0.080                         | 0.80         |
| OTRAS                                   | 0.058        | 0.58         | 0.058                         | 0.58         |
| <b>Total</b>                            | <b>1.331</b> | <b>13.31</b> | <b>1.331</b>                  | <b>13.31</b> |

\*Porcentajes y cifras en pesos anualizados. Monto por cada \$1,000 pesos invertidos.

Otros incluye: proveedor de precios, calificadora, otros servicios administrativos, custodia, cuotas de CNBV, de Bolsas de Valores y de Auditoría Externa.

**Información sobre comisiones y remuneraciones**

Las comisiones por compra y venta de acciones pueden disminuir el monto total de su inversión. Esto implica que usted recibiría un monto menor después de una operación. Lo anterior, junto con las comisiones pagadas por el Fondo, representa una reducción del rendimiento total que recibiría por su inversión en el Fondo de Inversión.

Algunos prestadores de servicios pueden establecer acuerdos con el Fondo de Inversión y ofrecerle descuentos por sus servicios. Para conocer de su existencia y el posible beneficio para usted, pregunte con su distribuidor.

El Prospecto de Información al Público Inversionista contiene un mayor detalle de los conflictos de interés a los que pudiera estar sujeto cualquier prestador de servicios del Fondo de Inversión.

**Políticas para la compra - venta de acciones**

|                                     |                            |                             |  |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|--|
| <b>Plazo mínimo de permanencia:</b> | No tiene.                  | <b>Liquidez:</b>            | 48 horas (las solicitudes reciben todos los días hábiles).   |
| <b>Recepción de órdenes:</b>        | Todos los días hábiles.    | <b>Horario:</b>             | <b>Apertura:</b> 08:00 horas, tiempo del centro de México.<br><b>Cierre:</b> 10:30 horas, tiempo del centro de México. |
| <b>Ejecución de operaciones:</b>    | Mismo día de la recepción. | <b>Límites de recompra:</b> | Hasta el 10% del activo neto del Fondo.  |
| <b>Liquidación de operaciones:</b>  | 48 horas hábiles.          | <b>Diferencial*:</b>        | El Fondo no ha aplicado diferencial alguno en el precio de sus acciones.   |

\*El Fondo de Inversión, ante condiciones desordenadas de mercado u operaciones inusuales, podrá aplicar a las operaciones de compraventa de sus acciones, un diferencial sobre el precio actualizado de valuación de dichas acciones, que haya determinado previamente, y conservarlo a favor de los inversionistas que permanezcan en el Fondo de Inversión.

**Prestadores de Servicios**

|   |   |
|---|---|
| <b>Operadora:</b>                           | Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte. |
| <b>Distribuidora:</b>                       | Consultar Punto 2, inciso f) del Prospecto de Información.  |
| <b>Valuadora:</b>                           | GAF Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora Limitada de Fondos de Inversión.                                |
| <b>Institución Calificadora de Valores:</b> | Fitch México, S.A. de C.V.  |
| <b>Proveedor de Precios:</b>                | Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S.A. de C.V.  |

**Advertencias**

El Fondo de Inversión no cuenta con garantía alguna del Gobierno Federal, las entidades de la administración pública paraestatal, ni de la Sociedad Operadora ni del Grupo Financiero al que pertenece. La inversión en el Fondo de Inversión se encuentra respaldada hasta por el monto de su patrimonio.

La autorización de los prospectos de información al público inversionista no implica certificación sobre la bondad de las acciones que emitan o sobre la solvencia, liquidez, calidad crediticia o desempeño futuro de los fondos, ni de los Activos Objeto de Inversión que conforman su cartera.

Ningún intermediario financiero, apoderado para celebrar operaciones con el público, o cualquier otra persona, está autorizado para proporcionar información o hacer declaración alguna adicional al contenido del presente documento o el Prospecto de Información al Público Inversionista, por lo que deberán entenderse como no autorizados por el Fondo de Inversión.

Para mayor información, visite la página de internet de nuestra Sociedad Operadora y/o Distribuidoras, en donde podrá consultar el Prospecto de Información al Público Inversionista, así como la información actualizada sobre la cartera de inversiones del Fondo de Inversión.

El presente documento y el Prospecto de Información al Público Inversionista son los únicos documentos de venta que reconoce el Fondo de Inversión como válidos.

**Centro de Atención al Inversionista**

|                  |   |
|------------------|---|
| <b>Contacto:</b> | Centro de Contacto.                               |
| <b>Teléfono:</b> | 800 493 2000                                      |
| <b>Horario:</b>  | 08:30 a 18:00 horas, tiempo del centro de México. |

**Página(s) electrónica(s)**

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| <b>Operadora:</b>     | www.banorte.com/fondosdeinversion |
| <b>Distribuidora:</b> | www.banorte.com/fondosdeinversion |

**DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN**

Fondo Banorte 21, S.A. de C.V. F.I.I.D. administrado por Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, GFB

|                        |  |                           |  |                                |
|------------------------|--|---------------------------|--|--------------------------------|
| Tipo:                  | INSTRUMENTOS DE DEUDA  | Serie B, Clase Accionaria | Posibles Adquirentes   | Monto Mínimo de Inversión (\$) |
| Categoría:             | CORTO PLAZO MONEDA EXTRANJERA (IDCPME)                             | APIF                      | PERSONAS FÍSICAS (artículo 106 fracción IV, inciso b) de CUFÍ) | Sin monto mínimo de inversión  |
| Clave de Pizarra:      | NTEEURO  |                           |  |                                |
| Calificación:          | AAAf/S5(mex)<br>Escala de calificación de Calificadora y homogénea |                           |  |                                |
| Fecha de Autorización: | 12 enero 2024 No. Oficio 157/026/2024                              |                           |  |                                |

**Importante:** El valor de un Fondo de Inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de Inversión**

El objetivo fundamental de NTEEURO será ofrecer un portafolio conformado primordialmente por activos objeto de inversión de deuda, Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda, Exchange Traded Funds (ETF'S) y/o Trackers denominados, indizados y/o referenciados al Euro, complementando la inversión con otros activos de deuda en moneda nacional. Dichos activos podrán estar emitidos en el mercado local o en mercados internacionales, de corto plazo principalmente, y de mediano y largo plazo en menor medida.

NTEEURO está orientado a pequeños, medianos y grandes inversionistas, personas físicas, personas morales, personas no sujetas a retención y/o Fondos de Inversión (considerando su nivel de complejidad o sofisticación) que busquen un nivel moderado a alto de riesgo y alta liquidez en función del objetivo, estrategia y calificación del Fondo.

El horizonte de inversión para el inversionista que compra acciones de NTEEURO es de corto plazo, por lo que se sugiere permanecer en el Fondo por lo menos un año para obtener los beneficios de la estrategia.

**Información Relevante**

Los Fondos de Inversión no cuentan con Asamblea de Accionistas, Consejo de Administración o Comisario:

- Las funciones de la Asamblea de Accionistas, así como las actividades del Consejo de Administración están encomendadas a Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte.
- La vigilancia del Fondo está asignada al Contralor Normativo de la Sociedad Operadora.

**Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos:** 2.58%, con un nivel de confianza del 95% a dos colas.

La pérdida máxima que en un escenario pesimista (3 en 100 veces) puede enfrentar el Fondo en un lapso de 1 día es de \$25.80 pesos por cada \$1,000 pesos invertidos. (Este dato es solo una estimación, y es válida únicamente en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

Se entiende por VaR a la pérdida máxima potencial en condiciones normales de mercado que pueden tener los activos netos de un Fondo de Inversión, calculada con un horizonte de tiempo de 1 día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones históricas en los factores de riesgo.

**Desempeño Histórico**

|               |   |
|---------------|---|
| Clase<br>APIF | Índice de Referencia: Tipo de Cambio del EURO (Valmer). |
|---------------|---|

**Tabla de Rendimientos nominales anualizados**

|                                 | Último Mes | Últimos 3 Meses | Últimos 12 Meses | Mes Rto. Bajo | Mes Rto. Alto |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|---------------|
| RENDIMIENTO BRUTO               | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| RENDIMIENTO NETO                | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| TASA LIBRE DE RIESGO (CETES 28) | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| ÍNDICE DE REFERENCIA            | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |

- El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.
- La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones o cualquier otro gasto.
- El desempeño del Fondo de Inversión en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá la inversión en el futuro.

**Régimen y Política de Inversión**

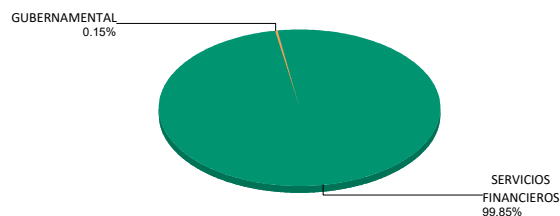
- a) Estrategia de Inversión: Activa.
- b) Montos máximos o mínimos de inversión de los principales activos objeto de inversión del Fondo:
- |  | Mín | Máx  |
|--|-----|------|
| Activos objeto de inversión de deuda denominados, indizados y/o referenciados al Euro.   | 95% | 100% |
| Mecanismos de inversión colectiva ETFs denominados, indizados y/o referenciados al Euro. |     | 100% |
| Reportos.  |     | 100% |
| Valores de deuda en moneda nacional.   |     | 5%   |
| Valores de fácil realización y/o con vencimiento menor a 3 meses.                        | 20% | 100% |
- c) Política de inversión: El Fondo podrá invertir en el mercado nacional y en mercados internacionales.
- d) NTEEURO buscará proporcionar, antes de gastos totales e impuestos, un rendimiento similar al tipo de cambio del EURO. Este índice será dado a conocer en [www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio](http://www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio).
- e) NTEEURO podrá invertir hasta un 100% de su activo neto en activos emitidos, avalados o aceptados por instituciones de crédito que formen parte del mismo Consorcio o Grupo empresarial al que pertenezca su Operadora de acuerdo al régimen de inversión, cumpliendo con lo establecido en el artículo 6 fracción I de la CUFÍ.
- f) NTEEURO podrá realizar operaciones de préstamo de valores, con un plazo máximo de 1 año, con prórrogas por igual periodo.
- g) NTEEURO no invertirá en instrumentos financieros derivados, valores estructurados ni en valores respaldados por activos. NTEEURO podrá invertir en certificados bursátiles fiduciarios indizados, ETF's y/o en Trackers listados en el SIC y/o en otros mercados.

**Composición de la Cartera de Inversión**

Principales inversiones al mes de marzo 2024

| Clave de Pizarra     | Activo Objeto de Inversión |                   |          | Monto Miles de \$ | %           |
|----------------------|----------------------------|-------------------|----------|-------------------|-------------|
|                      | Emisora                    | Nombre/Subyacente | Tipo     |                   |             |
| 140-012 2742284      | Chequera Euros             | N/A               | CHEQUERA | 115,256           | 99.83%      |
| 2BPAG91 250102       | BONOS Prot Ahorro          | N/A               | REPORTO  | 178               | 0.15%       |
| 340-012 2742136      | Chequera Pesos             | N/A               | CHEQUERA | 15                | 0.01%       |
| 4                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 5                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 6                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 7                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 8                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 9                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 10                   |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| <b>Cartera Total</b> |                            |                   |          | <b>115,449</b>    | <b>100%</b> |

**Por Sector de Actividad Económica**



**Comisiones y Remuneraciones por la Prestación de Servicios**
**Pagadas por el cliente**

| Concepto                                   | Clase APIF |            | Clase más representativa (F1) |            |
|--|------------|------------|-------------------------------|------------|
|  | %          | \$         | %                             | \$         |
| INCUMPLIMIENTO PLAZO MÍNIMO DE PERMANENCIA | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| INCUMPLIMIENTO SALDO MÍNIMO DE INVERSIÓN   | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| COMPRA DE ACCIONES                         | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| VENTA DE ACCIONES                          | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIOS POR ASESORÍA                     | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIO ADMINISTRACIÓN DE ACCIONES        | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| OTRAS                                      | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| <b>Total</b>                               | <b>n/a</b> | <b>n/a</b> | <b>n/a</b>                    | <b>n/a</b> |

No aplica para ninguna clase accionaria.

**Pagadas por el Fondo de Inversión**

(cifras correspondientes al mes de marzo 2024)

| Concepto                                | Clase APIF   |             | Clase más representativa (F1) |              |
|---|--------------|-------------|-------------------------------|--------------|
|   | %            | \$          | %                             | \$           |
| ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS               | 0.000        | 0.00        | 0.345                         | 3.45         |
| ADMINISTRACIÓN ACTIVOS S/ DESEMPEÑO     | n/a          | n/a         | n/a                           | n/a          |
| DISTRIBUCIÓN DE ACCIONES                | 0.000        | 0.00        | 0.805                         | 8.05         |
| VALUACIÓN DE ACCIONES                   | 0.000        | 0.00        | 0.043                         | 0.43         |
| DEPÓSITO DE ACCIONES DEL FI             | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| DEPÓSITO DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| CONTABILIDAD                            | 0.000        | 0.00        | 0.080                         | 0.80         |
| OTRAS                                   | 0.000        | 0.00        | 0.058                         | 0.58         |
| <b>Total</b>                            | <b>0.000</b> | <b>0.00</b> | <b>1.331</b>                  | <b>13.31</b> |

\*Porcentajes y cifras en pesos anualizados. Monto por cada \$1,000 pesos invertidos.

Otros incluye: proveedor de precios, calificadora, otros servicios administrativos, custodia, cuotas de CNBV, de Bolsas de Valores y de Auditoría Externa.

**Información sobre comisiones y remuneraciones**

Las comisiones por compra y venta de acciones pueden disminuir el monto total de su inversión. Esto implica que usted recibiría un monto menor después de una operación. Lo anterior, junto con las comisiones pagadas por el Fondo, representa una reducción del rendimiento total que recibiría por su inversión en el Fondo de Inversión.

Algunos prestadores de servicios pueden establecer acuerdos con el Fondo de Inversión y ofrecerle descuentos por sus servicios. Para conocer de su existencia y el posible beneficio para usted, pregunte con su distribuidor.

El Prospecto de Información al Público Inversionista contiene un mayor detalle de los conflictos de interés a los que pudiera estar sujeto cualquier prestador de servicios del Fondo de Inversión.

**Políticas para la compra - venta de acciones**

|                                     |                            |                             |  |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|--|
| <b>Plazo mínimo de permanencia:</b> | No tiene.                  | <b>Liquidez:</b>            | 48 horas (las solicitudes reciben todos los días hábiles).   |
| <b>Recepción de órdenes:</b>        | Todos los días hábiles.    | <b>Horario:</b>             | <b>Apertura:</b> 08:00 horas, tiempo del centro de México.<br><b>Cierre:</b> 10:30 horas, tiempo del centro de México. |
| <b>Ejecución de operaciones:</b>    | Mismo día de la recepción. | <b>Límites de recompra:</b> | Hasta el 10% del activo neto del Fondo.  |
| <b>Liquidación de operaciones:</b>  | 48 horas hábiles.          | <b>Diferencial*:</b>        | El Fondo no ha aplicado diferencial alguno en el precio de sus acciones.   |

\*El Fondo de Inversión, ante condiciones desordenadas de mercado u operaciones inusuales, podrá aplicar a las operaciones de compraventa de sus acciones, un diferencial sobre el precio actualizado de valuación de dichas acciones, que haya determinado previamente, y conservarlo a favor de los inversionistas que permanezcan en el Fondo de Inversión.

**Prestadores de Servicios**

|   |   |
|---|---|
| <b>Operadora:</b>                           | Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte. |
| <b>Distribuidora:</b>                       | Consultar Punto 2, inciso f) del Prospecto de Información.  |
| <b>Valuadora:</b>                           | GAF Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora Limitada de Fondos de Inversión.                                |
| <b>Institución Calificadora de Valores:</b> | Fitch México, S.A. de C.V.  |
| <b>Proveedor de Precios:</b>                | Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S.A. de C.V.  |

**Advertencias**

El Fondo de Inversión no cuenta con garantía alguna del Gobierno Federal, las entidades de la administración pública paraestatal, ni de la Sociedad Operadora ni del Grupo Financiero al que pertenece. La inversión en el Fondo de Inversión se encuentra respaldada hasta por el monto de su patrimonio.

La autorización de los prospectos de información al público inversionista no implica certificación sobre la bondad de las acciones que emitan o sobre la solvencia, liquidez, calidad crediticia o desempeño futuro de los fondos, ni de los Activos Objeto de Inversión que conforman su cartera.

Ningún intermediario financiero, apoderado para celebrar operaciones con el público, o cualquier otra persona, está autorizado para proporcionar información o hacer declaración alguna adicional al contenido del presente documento o el Prospecto de Información al Público Inversionista, por lo que deberán entenderse como no autorizados por el Fondo de Inversión.

Para mayor información, visite la página de internet de nuestra Sociedad Operadora y/o Distribuidoras, en donde podrá consultar el Prospecto de Información al Público Inversionista, así como la información actualizada sobre la cartera de inversiones del Fondo de Inversión.

El presente documento y el Prospecto de Información al Público Inversionista son los únicos documentos de venta que reconoce el Fondo de Inversión como válidos.

**Centro de Atención al Inversionista**

|                  |   |
|------------------|---|
| <b>Contacto:</b> | Centro de Contacto.                               |
| <b>Teléfono:</b> | 800 493 2000                                      |
| <b>Horario:</b>  | 08:30 a 18:00 horas, tiempo del centro de México. |

**Página(s) electrónica(s)**

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| <b>Operadora:</b>     | www.banorte.com/fondosdeinversion |
| <b>Distribuidora:</b> | www.banorte.com/fondosdeinversion |

**DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN**

Fondo Banorte 21, S.A. de C.V. F.I.I.D. administrado por Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, GFB

|                               |  |                                  |                             |                                       |
|-------------------------------|--|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------------|
| <b>Tipo:</b>                  | INSTRUMENTOS DE DEUDA  | <b>Serie B, Clase Accionaria</b> | <b>Posibles Adquirentes</b> | <b>Monto Mínimo de Inversión (\$)</b> |
| <b>Categoría:</b>             | CORTO PLAZO MONEDA EXTRANJERA (IDCPME)                             | M1                               | PERSONAS MORALES            | Sin monto mínimo de inversión         |
| <b>Clave de Pizarra:</b>      | NTEEURO  |                                  |                             |                                       |
| <b>Calificación:</b>          | AAAf/S5(mex)<br>Escala de calificación de Calificadora y homogénea |                                  |                             |                                       |
| <b>Fecha de Autorización:</b> | 12 enero 2024 No. Oficio 157/026/2024                              |                                  |                             |                                       |

**Importante:** El valor de un Fondo de Inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de Inversión**

El objetivo fundamental de NTEEURO será ofrecer un portafolio conformado primordialmente por activos objeto de inversión de deuda, Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda, Exchange Traded Funds (ETF'S) y/o Trackers denominados, indizados y/o referenciados al Euro, complementando la inversión con otros activos de deuda en moneda nacional. Dichos activos podrán estar emitidos en el mercado local o en mercados internacionales, de corto plazo principalmente, y de mediano y largo plazo en menor medida.

NTEEURO está orientado a pequeños, medianos y grandes inversionistas, personas físicas, personas morales, personas no sujetas a retención y/o Fondos de Inversión (considerando su nivel de complejidad o sofisticación) que busquen un nivel moderado a alto de riesgo y alta liquidez en función del objetivo, estrategia y calificación del Fondo.

El horizonte de inversión para el inversionista que compra acciones de NTEEURO es de corto plazo, por lo que se sugiere permanecer en el Fondo por lo menos un año para obtener los beneficios de la estrategia.

**Información Relevante**

Los Fondos de Inversión no cuentan con Asamblea de Accionistas, Consejo de Administración o Comisario:

- Las funciones de la Asamblea de Accionistas, así como las actividades del Consejo de Administración están encomendadas a Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte.
- La vigilancia del Fondo está asignada al Contralor Normativo de la Sociedad Operadora.

**Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos:** 2.58%, con un nivel de confianza del 95% a dos colas.

La pérdida máxima que en un escenario pesimista (3 en 100 veces) puede enfrentar el Fondo en un lapso de 1 día es de \$25.80 pesos por cada \$1,000 pesos invertidos. (Este dato es solo una estimación, y es válida únicamente en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

Se entiende por VaR a la pérdida máxima potencial en condiciones normales de mercado que pueden tener los activos netos de un Fondo de Inversión, calculada con un horizonte de tiempo de 1 día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones históricas en los factores de riesgo.

**Desempeño Histórico**

|                    |  |
|--------------------|--|
| Clase<br><b>M1</b> | <b>Índice de Referencia:</b> Tipo de Cambio del EURO (Valmer). |
|--------------------|--|

**Tabla de Rendimientos nominales anualizados**

|                                 | Último Mes | Últimos 3 Meses | Últimos 12 Meses | Mes Rto. Bajo | Mes Rto. Alto |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|---------------|
| RENDIMIENTO BRUTO               | -29.24 %   | -16.65 %        | N/A              | -29.24 %      | -8.41 %       |
| RENDIMIENTO NETO                | -30.29 %   | -17.89 %        | N/A              | -30.29 %      | -9.78 %       |
| TASA LIBRE DE RIESGO (CETES 28) | 11.03 %    | 11.13 %         | N/A              | 10.91 %       | 11.29 %       |
| ÍNDICE DE REFERENCIA            | -36.04 %   | -15.51 %        | N/A              | -36.04 %      | -4.16 %       |

- El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.
- La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones o cualquier otro gasto.
- El desempeño del Fondo de Inversión en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá la inversión en el futuro.

**Régimen y Política de Inversión**

a) Estrategia de Inversión: Activa.

b) Montos máximos o mínimos de inversión de los principales activos objeto de inversión del Fondo:

|  | Mín | Máx  |
|--|-----|------|
| Activos objeto de inversión de deuda denominados, indizados y/o referenciados al Euro.   | 95% | 100% |
| Mecanismos de inversión colectiva ETFs denominados, indizados y/o referenciados al Euro. |     | 100% |
| Reportos.  |     | 100% |
| Valores de deuda en moneda nacional.   |     | 5%   |
| Valores de fácil realización y/o con vencimiento menor a 3 meses.                        | 20% | 100% |

c) Política de inversión: El Fondo podrá invertir en el mercado nacional y en mercados internacionales.

d) NTEEURO buscará proporcionar, antes de gastos totales e impuestos, un rendimiento similar al tipo de cambio del EURO. Este índice será dado a conocer en [www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio](http://www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio).

e) NTEEURO podrá invertir hasta un 100% de su activo neto en activos emitidos, avalados o aceptados por instituciones de crédito que formen parte del mismo Consorcio o Grupo empresarial al que pertenezca su Operadora de acuerdo al régimen de inversión, cumpliendo con lo establecido en el artículo 6 fracción I de la CUIFI.

f) NTEEURO podrá realizar operaciones de préstamo de valores, con un plazo máximo de 1 año, con prórrogas por igual periodo.

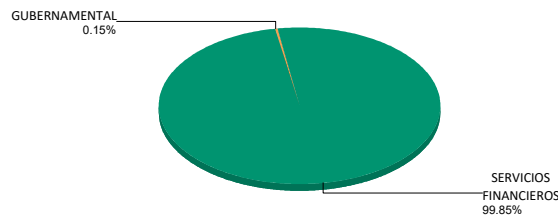
g) NTEEURO no invertirá en instrumentos financieros derivados, valores estructurados ni en valores respaldados por activos. NTEEURO podrá invertir en certificados bursátiles fiduciarios indizados, ETF's y/o en Trackers listados en el SIC y/o en otros mercados.

**Composición de la Cartera de Inversión**

Principales inversiones al mes de marzo 2024

| Clave de Pizarra     | Activo Objeto de Inversión |                   |          | Monto Miles de \$ | %           |
|----------------------|----------------------------|-------------------|----------|-------------------|-------------|
|                      | Emisora                    | Nombre/Subyacente | Tipo     |                   |             |
| 140-012 2742284      | Chequera Euros             | N/A               | CHEQUERA | 115,256           | 99.83%      |
| 2BPAG91 250102       | BONOS Prot Ahorro          | N/A               | REPORTO  | 178               | 0.15%       |
| 340-012 2742136      | Chequera Pesos             | N/A               | CHEQUERA | 15                | 0.01%       |
| 4                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 5                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 6                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 7                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 8                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 9                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 10                   |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| <b>Cartera Total</b> |                            |                   |          | <b>115,449</b>    | <b>100%</b> |

**Por Sector de Actividad Económica**



A partir de la fecha 09/10/2023, se realizó el primer cruce de esta serie.

**Comisiones y Remuneraciones por la Prestación de Servicios**
**Pagadas por el cliente**

| Concepto                                   | Clase M1   |            | Clase más representativa (F1) |            |
|--|------------|------------|-------------------------------|------------|
|  | %          | \$         | %                             | \$         |
| INCUMPLIMIENTO PLAZO MÍNIMO DE PERMANENCIA | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| INCUMPLIMIENTO SALDO MÍNIMO DE INVERSIÓN   | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| COMPRA DE ACCIONES                         | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| VENTA DE ACCIONES                          | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIOS POR ASESORÍA                     | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIO ADMINISTRACIÓN DE ACCIONES        | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| OTRAS                                      | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| <b>Total</b>                               | <b>n/a</b> | <b>n/a</b> | <b>n/a</b>                    | <b>n/a</b> |

No aplica para ninguna clase accionaria.

**Pagadas por el Fondo de Inversión**

(cifras correspondientes al mes de marzo 2024)

| Concepto                                | Clase M1     |              | Clase más representativa (F1) |              |
|---|--------------|--------------|-------------------------------|--------------|
|   | %            | \$           | %                             | \$           |
| ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS               | 0.345        | 3.45         | 0.345                         | 3.45         |
| ADMINISTRACIÓN ACTIVOS S/ DESEMPEÑO     | n/a          | n/a          | n/a                           | n/a          |
| DISTRIBUCIÓN DE ACCIONES                | 0.805        | 8.05         | 0.805                         | 8.05         |
| VALUACIÓN DE ACCIONES                   | 0.042        | 0.42         | 0.043                         | 0.43         |
| DEPÓSITO DE ACCIONES DEL FI             | 0.000        | 0.00         | 0.000                         | 0.00         |
| DEPÓSITO DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN | 0.000        | 0.00         | 0.000                         | 0.00         |
| CONTABILIDAD                            | 0.078        | 0.78         | 0.080                         | 0.80         |
| OTRAS                                   | 0.057        | 0.57         | 0.058                         | 0.58         |
| <b>Total</b>                            | <b>1.327</b> | <b>13.27</b> | <b>1.331</b>                  | <b>13.31</b> |

\*Porcentajes y cifras en pesos anualizados. Monto por cada \$1,000 pesos invertidos.

Otros incluye: proveedor de precios, calificadora, otros servicios administrativos, custodia, cuotas de CNBV, de Bolsas de Valores y de Auditoría Externa.

**Información sobre comisiones y remuneraciones**

Las comisiones por compra y venta de acciones pueden disminuir el monto total de su inversión. Esto implica que usted recibiría un monto menor después de una operación. Lo anterior, junto con las comisiones pagadas por el Fondo, representa una reducción del rendimiento total que recibiría por su inversión en el Fondo de Inversión.

Algunos prestadores de servicios pueden establecer acuerdos con el Fondo de Inversión y ofrecerle descuentos por sus servicios. Para conocer de su existencia y el posible beneficio para usted, pregunte con su distribuidor.

El Prospecto de Información al Público Inversionista contiene un mayor detalle de los conflictos de interés a los que pudiera estar sujeto cualquier prestador de servicios del Fondo de Inversión.

**Políticas para la compra - venta de acciones**

|                                     |                            |                             |  |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|--|
| <b>Plazo mínimo de permanencia:</b> | No tiene.                  | <b>Liquidez:</b>            | 48 horas (las solicitudes reciben todos los días hábiles).   |
| <b>Recepción de órdenes:</b>        | Todos los días hábiles.    | <b>Horario:</b>             | <b>Apertura:</b> 08:00 horas, tiempo del centro de México.<br><b>Cierre:</b> 10:30 horas, tiempo del centro de México. |
| <b>Ejecución de operaciones:</b>    | Mismo día de la recepción. | <b>Límites de recompra:</b> | Hasta el 10% del activo neto del Fondo.  |
| <b>Liquidación de operaciones:</b>  | 48 horas hábiles.          | <b>Diferencial*:</b>        | El Fondo no ha aplicado diferencial alguno en el precio de sus acciones.   |

\*El Fondo de Inversión, ante condiciones desordenadas de mercado u operaciones inusuales, podrá aplicar a las operaciones de compraventa de sus acciones, un diferencial sobre el precio actualizado de valuación de dichas acciones, que haya determinado previamente, y conservarlo a favor de los inversionistas que permanezcan en el Fondo de Inversión.

**Prestadores de Servicios**

|   |   |
|---|---|
| <b>Operadora:</b>                           | Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte. |
| <b>Distribuidora:</b>                       | Consultar Punto 2, inciso f) del Prospecto de Información.  |
| <b>Valuadora:</b>                           | GAF Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora Limitada de Fondos de Inversión.                                |
| <b>Institución Calificadora de Valores:</b> | Fitch México, S.A. de C.V.  |
| <b>Proveedor de Precios:</b>                | Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S.A. de C.V.  |

**Advertencias**

El Fondo de Inversión no cuenta con garantía alguna del Gobierno Federal, las entidades de la administración pública paraestatal, ni de la Sociedad Operadora ni del Grupo Financiero al que pertenece. La inversión en el Fondo de Inversión se encuentra respaldada hasta por el monto de su patrimonio.

La autorización de los prospectos de información al público inversionista no implica certificación sobre la bondad de las acciones que emitan o sobre la solvencia, liquidez, calidad crediticia o desempeño futuro de los fondos, ni de los Activos Objeto de Inversión que conforman su cartera.

Ningún intermediario financiero, apoderado para celebrar operaciones con el público, o cualquier otra persona, está autorizado para proporcionar información o hacer declaración alguna adicional al contenido del presente documento o el Prospecto de Información al Público Inversionista, por lo que deberán entenderse como no autorizados por el Fondo de Inversión.

Para mayor información, visite la página de internet de nuestra Sociedad Operadora y/o Distribuidoras, en donde podrá consultar el Prospecto de Información al Público Inversionista, así como la información actualizada sobre la cartera de inversiones del Fondo de Inversión.

El presente documento y el Prospecto de Información al Público Inversionista son los únicos documentos de venta que reconoce el Fondo de Inversión como válidos.

**Centro de Atención al Inversionista**

|                  |   |
|------------------|---|
| <b>Contacto:</b> | Centro de Contacto.                               |
| <b>Teléfono:</b> | 800 493 2000                                      |
| <b>Horario:</b>  | 08:30 a 18:00 horas, tiempo del centro de México. |

**Página(s) electrónica(s)**

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| <b>Operadora:</b>     | www.banorte.com/fondosdeinversion |
| <b>Distribuidora:</b> | www.banorte.com/fondosdeinversion |

**DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN**

Fondo Banorte 21, S.A. de C.V. F.I.I.D. administrado por Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, GFB

|                               |  |                                  |  |                                       |
|-------------------------------|--|----------------------------------|--|---------------------------------------|
| <b>Tipo:</b>                  | INSTRUMENTOS DE DEUDA  | <b>Serie B, Clase Accionaria</b> | <b>Posibles Adquirentes</b>  | <b>Monto Mínimo de Inversión (\$)</b> |
| <b>Categoría:</b>             | CORTO PLAZO MONEDA EXTRANJERA (IDCPME)                             | APIM                             | PERSONAS MORALES<br>(artículo 106 fracción IV,<br>inciso b) de CUFI) | Sin monto mínimo de inversión         |
| <b>Clave de Pizarra:</b>      | NTEEURO  |                                  |  |                                       |
| <b>Calificación:</b>          | AAAf/S5(mex)<br>Escala de calificación de Calificadora y homogénea |                                  |  |                                       |
| <b>Fecha de Autorización:</b> | 12 enero 2024 No. Oficio 157/026/2024                              |                                  |  |                                       |

**Importante:** El valor de un Fondo de Inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de Inversión**

El objetivo fundamental de NTEEURO será ofrecer un portafolio conformado primordialmente por activos objeto de inversión de deuda, Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda, Exchange Traded Funds (ETF'S) y/o Trackers denominados, indizados y/o referenciados al Euro, complementando la inversión con otros activos de deuda en moneda nacional. Dichos activos podrán estar emitidos en el mercado local o en mercados internacionales, de corto plazo principalmente, y de mediano y largo plazo en menor medida.

NTEEURO está orientado a pequeños, medianos y grandes inversionistas, personas físicas, personas morales, personas no sujetas a retención y/o Fondos de Inversión (considerando su nivel de complejidad o sofisticación) que busquen un nivel moderado a alto de riesgo y alta liquidez en función del objetivo, estrategia y calificación del Fondo.

El horizonte de inversión para el inversionista que compra acciones de NTEEURO es de corto plazo, por lo que se sugiere permanecer en el Fondo por lo menos un año para obtener los beneficios de la estrategia.

**Información Relevante**

Los Fondos de Inversión no cuentan con Asamblea de Accionistas, Consejo de Administración o Comisario:

- Las funciones de la Asamblea de Accionistas, así como las actividades del Consejo de Administración están encomendadas a Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte.
- La vigilancia del Fondo está asignada al Contralor Normativo de la Sociedad Operadora.

**Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos:** 2.58%, con un nivel de confianza del 95% a dos colas.

La pérdida máxima que en un escenario pesimista (3 en 100 veces) puede enfrentar el Fondo en un lapso de 1 día es de \$25.80 pesos por cada \$1,000 pesos invertidos. (Este dato es solo una estimación, y es válida únicamente en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

Se entiende por VaR a la pérdida máxima potencial en condiciones normales de mercado que pueden tener los activos netos de un Fondo de Inversión, calculada con un horizonte de tiempo de 1 día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones históricas en los factores de riesgo.

**Desempeño Histórico**

|              |  |
|--------------|--|
| <b>Clase</b> | <b>Índice de Referencia:</b> Tipo de Cambio del EURO (Valmer). |
| APIM         |  |

**Tabla de Rendimientos nominales anualizados**

|                                 | Último Mes | Últimos 3 Meses | Últimos 12 Meses | Mes Rto. Bajo | Mes Rto. Alto |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|---------------|
| RENDIMIENTO BRUTO               | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| RENDIMIENTO NETO                | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| TASA LIBRE DE RIESGO (CETES 28) | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| ÍNDICE DE REFERENCIA            | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |

- El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.
- La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones o cualquier otro gasto.
- El desempeño del Fondo de Inversión en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá la inversión en el futuro.

**Régimen y Política de Inversión**

a) Estrategia de Inversión: Activa.

b) Montos máximos o mínimos de inversión de los principales activos objeto de inversión del Fondo:

|  | Mín | Máx  |
|--|-----|------|
| Activos objeto de inversión de deuda denominados, indizados y/o referenciados al Euro.   | 95% | 100% |
| Mecanismos de inversión colectiva ETFs denominados, indizados y/o referenciados al Euro. |     | 100% |
| Reportos.  |     | 100% |
| Valores de deuda en moneda nacional.   |     | 5%   |
| Valores de fácil realización y/o con vencimiento menor a 3 meses.                        | 20% | 100% |

c) Política de inversión: El Fondo podrá invertir en el mercado nacional y en mercados internacionales.

d) NTEEURO buscará proporcionar, antes de gastos totales e impuestos, un rendimiento similar al tipo de cambio del EURO. Este índice será dado a conocer en [www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio](http://www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio).

e) NTEEURO podrá invertir hasta un 100% de su activo neto en activos emitidos, avalados o aceptados por instituciones de crédito que formen parte del mismo Consorcio o Grupo empresarial al que pertenezca su Operadora de acuerdo al régimen de inversión, cumpliendo con lo establecido en el artículo 6 fracción I de la CUFI.

f) NTEEURO podrá realizar operaciones de préstamo de valores, con un plazo máximo de 1 año, con prórrogas por igual periodo.

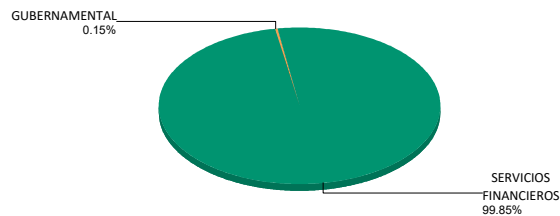
g) NTEEURO no invertirá en instrumentos financieros derivados, valores estructurados ni en valores respaldados por activos. NTEEURO podrá invertir en certificados bursátiles fiduciarios indizados, ETF's y/o en Trackers listados en el SIC y/o en otros mercados.

**Composición de la Cartera de Inversión**

Principales inversiones al mes de marzo 2024

| Clave de Pizarra     | Activo Objeto de Inversión |                   |          | Monto Miles de \$ | %           |
|----------------------|----------------------------|-------------------|----------|-------------------|-------------|
|                      | Emisora                    | Nombre/Subyacente | Tipo     |                   |             |
| 140-012 2742284      | Chequera Euros             | N/A               | CHEQUERA | 115,256           | 99.83%      |
| 2BPAG91 250102       | BONOS Prot Ahorro          | N/A               | REPORTO  | 178               | 0.15%       |
| 340-012 2742136      | Chequera Pesos             | N/A               | CHEQUERA | 15                | 0.01%       |
| 4                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 5                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 6                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 7                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 8                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 9                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 10                   |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| <b>Cartera Total</b> |                            |                   |          | <b>115,449</b>    | <b>100%</b> |

**Por Sector de Actividad Económica**



**Comisiones y Remuneraciones por la Prestación de Servicios**
**Pagadas por el cliente**

| Concepto                                   | Clase APIM |            | Clase más representativa (F1) |            |
|--|------------|------------|-------------------------------|------------|
|  | %          | \$         | %                             | \$         |
| INCUMPLIMIENTO PLAZO MÍNIMO DE PERMANENCIA | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| INCUMPLIMIENTO SALDO MÍNIMO DE INVERSIÓN   | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| COMPRA DE ACCIONES                         | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| VENTA DE ACCIONES                          | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIOS POR ASESORÍA                     | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIO ADMINISTRACIÓN DE ACCIONES        | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| OTRAS                                      | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| <b>Total</b>                               | <b>n/a</b> | <b>n/a</b> | <b>n/a</b>                    | <b>n/a</b> |

No aplica para ninguna clase accionaria.

**Pagadas por el Fondo de Inversión**

(cifras correspondientes al mes de marzo 2024)

| Concepto                                | Clase APIM   |             | Clase más representativa (F1) |              |
|---|--------------|-------------|-------------------------------|--------------|
|   | %            | \$          | %                             | \$           |
| ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS               | 0.000        | 0.00        | 0.345                         | 3.45         |
| ADMINISTRACIÓN ACTIVOS S/ DESEMPEÑO     | n/a          | n/a         | n/a                           | n/a          |
| DISTRIBUCIÓN DE ACCIONES                | 0.000        | 0.00        | 0.805                         | 8.05         |
| VALUACIÓN DE ACCIONES                   | 0.000        | 0.00        | 0.043                         | 0.43         |
| DEPÓSITO DE ACCIONES DEL FI             | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| DEPÓSITO DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| CONTABILIDAD                            | 0.000        | 0.00        | 0.080                         | 0.80         |
| OTRAS                                   | 0.000        | 0.00        | 0.058                         | 0.58         |
| <b>Total</b>                            | <b>0.000</b> | <b>0.00</b> | <b>1.331</b>                  | <b>13.31</b> |

\*Porcentajes y cifras en pesos anualizados. Monto por cada \$1,000 pesos invertidos.

Otros incluye: proveedor de precios, calificadora, otros servicios administrativos, custodia, cuotas de CNBV, de Bolsas de Valores y de Auditoría Externa.

**Información sobre comisiones y remuneraciones**

Las comisiones por compra y venta de acciones pueden disminuir el monto total de su inversión. Esto implica que usted recibiría un monto menor después de una operación. Lo anterior, junto con las comisiones pagadas por el Fondo, representa una reducción del rendimiento total que recibiría por su inversión en el Fondo de Inversión.

Algunos prestadores de servicios pueden establecer acuerdos con el Fondo de Inversión y ofrecerle descuentos por sus servicios. Para conocer de su existencia y el posible beneficio para usted, pregunte con su distribuidor.

El Prospecto de Información al Público Inversionista contiene un mayor detalle de los conflictos de interés a los que pudiera estar sujeto cualquier prestador de servicios del Fondo de Inversión.

**Políticas para la compra - venta de acciones**

|                                     |                            |                             |  |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|--|
| <b>Plazo mínimo de permanencia:</b> | No tiene.                  | <b>Liquidez:</b>            | 48 horas (las solicitudes reciben todos los días hábiles).   |
| <b>Recepción de órdenes:</b>        | Todos los días hábiles.    | <b>Horario:</b>             | <b>Apertura:</b> 08:00 horas, tiempo del centro de México.<br><b>Cierre:</b> 10:30 horas, tiempo del centro de México. |
| <b>Ejecución de operaciones:</b>    | Mismo día de la recepción. | <b>Límites de recompra:</b> | Hasta el 10% del activo neto del Fondo.  |
| <b>Liquidación de operaciones:</b>  | 48 horas hábiles.          | <b>Diferencial*:</b>        | El Fondo no ha aplicado diferencial alguno en el precio de sus acciones.   |

\*El Fondo de Inversión, ante condiciones desordenadas de mercado u operaciones inusuales, podrá aplicar a las operaciones de compraventa de sus acciones, un diferencial sobre el precio actualizado de valuación de dichas acciones, que haya determinado previamente, y conservarlo a favor de los inversionistas que permanezcan en el Fondo de Inversión.

**Prestadores de Servicios**

|   |   |
|---|---|
| <b>Operadora:</b>                           | Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte. |
| <b>Distribuidora:</b>                       | Consultar Punto 2, inciso f) del Prospecto de Información.  |
| <b>Valuadora:</b>                           | GAF Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora Limitada de Fondos de Inversión.                                |
| <b>Institución Calificadora de Valores:</b> | Fitch México, S.A. de C.V.  |
| <b>Proveedor de Precios:</b>                | Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S.A. de C.V.  |

**Advertencias**

El Fondo de Inversión no cuenta con garantía alguna del Gobierno Federal, las entidades de la administración pública paraestatal, ni de la Sociedad Operadora ni del Grupo Financiero al que pertenece. La inversión en el Fondo de Inversión se encuentra respaldada hasta por el monto de su patrimonio.

La autorización de los prospectos de información al público inversionista no implica certificación sobre la bondad de las acciones que emitan o sobre la solvencia, liquidez, calidad crediticia o desempeño futuro de los fondos, ni de los Activos Objeto de Inversión que conforman su cartera.

Ningún intermediario financiero, apoderado para celebrar operaciones con el público, o cualquier otra persona, está autorizado para proporcionar información o hacer declaración alguna adicional al contenido del presente documento o el Prospecto de Información al Público Inversionista, por lo que deberán entenderse como no autorizados por el Fondo de Inversión.

Para mayor información, visite la página de internet de nuestra Sociedad Operadora y/o Distribuidoras, en donde podrá consultar el Prospecto de Información al Público Inversionista, así como la información actualizada sobre la cartera de inversiones del Fondo de Inversión.

El presente documento y el Prospecto de Información al Público Inversionista son los únicos documentos de venta que reconoce el Fondo de Inversión como válidos.

**Centro de Atención al Inversionista**

|                  |   |
|------------------|---|
| <b>Contacto:</b> | Centro de Contacto.                               |
| <b>Teléfono:</b> | 800 493 2000                                      |
| <b>Horario:</b>  | 08:30 a 18:00 horas, tiempo del centro de México. |

**Página(s) electrónica(s)**

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| <b>Operadora:</b>     | www.banorte.com/fondosdeinversion |
| <b>Distribuidora:</b> | www.banorte.com/fondosdeinversion |



**DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN**

Fondo Banorte 21, S.A. de C.V. F.I.I.D. administrado por Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, GFB

|                               |  |                                  |   |                                       |
|-------------------------------|--|----------------------------------|---|---------------------------------------|
| <b>Tipo:</b>                  | INSTRUMENTOS DE DEUDA  | <b>Serie B, Clase Accionaria</b> | <b>Posibles Adquirentes</b>                                       | <b>Monto Mínimo de Inversión (\$)</b> |
| <b>Categoría:</b>             | CORTO PLAZO MONEDA EXTRANJERA (IDCPME)                             | FF                               | FONDOS DE INVERSIÓN ADMINISTRADOS POR OPERADORA DE FONDOS BANORTE | Sin monto mínimo de inversión         |
| <b>Clave de Pizarra:</b>      | NTEEURO  |                                  |   |                                       |
| <b>Calificación:</b>          | AAAf/S5(mex)<br>Escala de calificación de Calificadora y homogénea |                                  |   |                                       |
| <b>Fecha de Autorización:</b> | 12 enero 2024 No. Oficio 157/026/2024                              |                                  |   |                                       |

**Importante:** El valor de un Fondo de Inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de Inversión**

El objetivo fundamental de NTEEURO será ofrecer un portafolio conformado primordialmente por activos objeto de inversión de deuda, Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda, Exchange Traded Funds (ETF'S) y/o Trackers denominados, indizados y/o referenciados al Euro, complementando la inversión con otros activos de deuda en moneda nacional. Dichos activos podrán estar emitidos en el mercado local o en mercados internacionales, de corto plazo principalmente, y de mediano y largo plazo en menor medida.

NTEEURO está orientado a pequeños, medianos y grandes inversionistas, personas físicas, personas morales, personas no sujetas a retención y/o Fondos de Inversión (considerando su nivel de complejidad o sofisticación) que busquen un nivel moderado a alto de riesgo y alta liquidez en función del objetivo, estrategia y calificación del Fondo.

El horizonte de inversión para el inversionista que compra acciones de NTEEURO es de corto plazo, por lo que se sugiere permanecer en el Fondo por lo menos un año para obtener los beneficios de la estrategia.

**Información Relevante**

Los Fondos de Inversión no cuentan con Asamblea de Accionistas, Consejo de Administración o Comisario:

- Las funciones de la Asamblea de Accionistas, así como las actividades del Consejo de Administración están encomendadas a Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte.
- La vigilancia del Fondo está asignada al Contralor Normativo de la Sociedad Operadora.

**Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos:** 2.58%, con un nivel de confianza del 95% a dos colas.

La pérdida máxima que en un escenario pesimista (3 en 100 veces) puede enfrentar el Fondo en un lapso de 1 día es de \$25.80 pesos por cada \$1,000 pesos invertidos. (Este dato es solo una estimación, y es válida únicamente en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

Se entiende por VaR a la pérdida máxima potencial en condiciones normales de mercado que pueden tener los activos netos de un Fondo de Inversión, calculada con un horizonte de tiempo de 1 día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones históricas en los factores de riesgo.

**Desempeño Histórico**

|                    |  |
|--------------------|--|
| <b>Clase</b><br>FF | <b>Índice de Referencia:</b> Tipo de Cambio del EURO (Valmer). |
|--------------------|--|

**Tabla de Rendimientos nominales anualizados**

|                                 | Último Mes | Últimos 3 Meses | Últimos 12 Meses | Mes Rto. Bajo | Mes Rto. Alto |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|---------------|
| RENDIMIENTO BRUTO               | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| RENDIMIENTO NETO                | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| TASA LIBRE DE RIESGO (CETES 28) | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |
| ÍNDICE DE REFERENCIA            | N/A        | N/A             | N/A              | N/A           | N/A           |

- El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.
- La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones o cualquier otro gasto.
- El desempeño del Fondo de Inversión en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá la inversión en el futuro.

**Régimen y Política de Inversión**

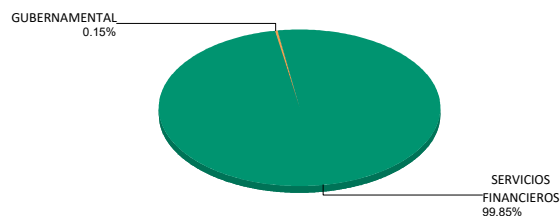
- a) Estrategia de Inversión: Activa.
- b) Montos máximos o mínimos de inversión de los principales activos objeto de inversión del Fondo:
- |  | Mín | Máx  |
|--|-----|------|
| Activos objeto de inversión de deuda denominados, indizados y/o referenciados al Euro.   | 95% | 100% |
| Mecanismos de inversión colectiva ETFs denominados, indizados y/o referenciados al Euro. |     | 100% |
| Reportos.  |     | 100% |
| Valores de deuda en moneda nacional.   |     | 5%   |
| Valores de fácil realización y/o con vencimiento menor a 3 meses.                        | 20% | 100% |
- c) Política de inversión: El Fondo podrá invertir en el mercado nacional y en mercados internacionales.
- d) NTEEURO buscará proporcionar, antes de gastos totales e impuestos, un rendimiento similar al tipo de cambio del EURO. Este índice será dado a conocer en [www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio](http://www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio).
- e) NTEEURO podrá invertir hasta un 100% de su activo neto en activos emitidos, avalados o aceptados por instituciones de crédito que formen parte del mismo Consorcio o Grupo empresarial al que pertenezca su Operadora de acuerdo al régimen de inversión, cumpliendo con lo establecido en el artículo 6 fracción I de la CUIFI.
- f) NTEEURO podrá realizar operaciones de préstamo de valores, con un plazo máximo de 1 año, con prórrogas por igual periodo.
- g) NTEEURO no invertirá en instrumentos financieros derivados, valores estructurados ni en valores respaldados por activos. NTEEURO podrá invertir en certificados bursátiles fiduciarios indizados, ETF's y/o en Trackers listados en el SIC y/o en otros mercados.

**Composición de la Cartera de Inversión**

Principales inversiones al mes de marzo 2024

| Clave de Pizarra     | Activo Objeto de Inversión |                   |          | Monto Miles de \$ | %           |
|----------------------|----------------------------|-------------------|----------|-------------------|-------------|
|                      | Emisora                    | Nombre/Subyacente | Tipo     |                   |             |
| 140-012 2742284      | Chequera Euros             | N/A               | CHEQUERA | 115,256           | 99.83%      |
| 2BPAG91 250102       | BONOS Prot Ahorro          | N/A               | REPORTO  | 178               | 0.15%       |
| 340-012 2742136      | Chequera Pesos             | N/A               | CHEQUERA | 15                | 0.01%       |
| 4                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 5                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 6                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 7                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 8                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 9                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 10                   |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| <b>Cartera Total</b> |                            |                   |          | <b>115,449</b>    | <b>100%</b> |

**Por Sector de Actividad Económica**



**Comisiones y Remuneraciones por la Prestación de Servicios**
**Pagadas por el cliente**

| Concepto                                   | Clase FF   |            | Clase más representativa (F1) |            |
|--|------------|------------|-------------------------------|------------|
|  | %          | \$         | %                             | \$         |
| INCUMPLIMIENTO PLAZO MÍNIMO DE PERMANENCIA | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| INCUMPLIMIENTO SALDO MÍNIMO DE INVERSIÓN   | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| COMPRA DE ACCIONES                         | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| VENTA DE ACCIONES                          | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIOS POR ASESORÍA                     | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIO ADMINISTRACIÓN DE ACCIONES        | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| OTRAS                                      | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| <b>Total</b>                               | <b>n/a</b> | <b>n/a</b> | <b>n/a</b>                    | <b>n/a</b> |

No aplica para ninguna clase accionaria.

**Pagadas por el Fondo de Inversión**

(cifras correspondientes al mes de marzo 2024)

| Concepto                                | Clase FF     |             | Clase más representativa (F1) |              |
|---|--------------|-------------|-------------------------------|--------------|
|   | %            | \$          | %                             | \$           |
| ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS               | 0.030        | 0.30        | 0.345                         | 3.45         |
| ADMINISTRACIÓN ACTIVOS S/ DESEMPEÑO     | n/a          | n/a         | n/a                           | n/a          |
| DISTRIBUCIÓN DE ACCIONES                | 0.070        | 0.70        | 0.805                         | 8.05         |
| VALUACIÓN DE ACCIONES                   | 0.000        | 0.00        | 0.043                         | 0.43         |
| DEPÓSITO DE ACCIONES DEL FI             | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| DEPÓSITO DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| CONTABILIDAD                            | 0.000        | 0.00        | 0.080                         | 0.80         |
| OTRAS                                   | 0.000        | 0.00        | 0.058                         | 0.58         |
| <b>Total</b>                            | <b>0.100</b> | <b>1.00</b> | <b>1.331</b>                  | <b>13.31</b> |

\*Porcentajes y cifras en pesos anualizados. Monto por cada \$1,000 pesos invertidos.

Otros incluye: proveedor de precios, calificadora, otros servicios administrativos, custodia, cuotas de CNBV, de Bolsas de Valores y de Auditoría Externa.

**Información sobre comisiones y remuneraciones**

Las comisiones por compra y venta de acciones pueden disminuir el monto total de su inversión. Esto implica que usted recibiría un monto menor después de una operación. Lo anterior, junto con las comisiones pagadas por el Fondo, representa una reducción del rendimiento total que recibiría por su inversión en el Fondo de Inversión.

Algunos prestadores de servicios pueden establecer acuerdos con el Fondo de Inversión y ofrecerle descuentos por sus servicios. Para conocer de su existencia y el posible beneficio para usted, pregunte con su distribuidor.

El Prospecto de Información al Público Inversionista contiene un mayor detalle de los conflictos de interés a los que pudiera estar sujeto cualquier prestador de servicios del Fondo de Inversión.

**Políticas para la compra - venta de acciones**

|                                     |                            |                             |  |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|--|
| <b>Plazo mínimo de permanencia:</b> | No tiene.                  | <b>Liquidez:</b>            | 48 horas (las solicitudes reciben todos los días hábiles).   |
| <b>Recepción de órdenes:</b>        | Todos los días hábiles.    | <b>Horario:</b>             | <b>Apertura:</b> 08:00 horas, tiempo del centro de México.<br><b>Cierre:</b> 10:30 horas, tiempo del centro de México. |
| <b>Ejecución de operaciones:</b>    | Mismo día de la recepción. | <b>Límites de recompra:</b> | Hasta el 10% del activo neto del Fondo.  |
| <b>Liquidación de operaciones:</b>  | 48 horas hábiles.          | <b>Diferencial*:</b>        | El Fondo no ha aplicado diferencial alguno en el precio de sus acciones.   |

\*El Fondo de Inversión, ante condiciones desordenadas de mercado u operaciones inusuales, podrá aplicar a las operaciones de compraventa de sus acciones, un diferencial sobre el precio actualizado de valuación de dichas acciones, que haya determinado previamente, y conservarlo a favor de los inversionistas que permanezcan en el Fondo de Inversión.

**Prestadores de Servicios**

|   |   |
|---|---|
| <b>Operadora:</b>                           | Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte. |
| <b>Distribuidora:</b>                       | Consultar Punto 2, inciso f) del Prospecto de Información.  |
| <b>Valuadora:</b>                           | GAF Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora Limitada de Fondos de Inversión.                                |
| <b>Institución Calificadora de Valores:</b> | Fitch México, S.A. de C.V.  |
| <b>Proveedor de Precios:</b>                | Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S.A. de C.V.  |

**Advertencias**

El Fondo de Inversión no cuenta con garantía alguna del Gobierno Federal, las entidades de la administración pública paraestatal, ni de la Sociedad Operadora ni del Grupo Financiero al que pertenece. La inversión en el Fondo de Inversión se encuentra respaldada hasta por el monto de su patrimonio.

La autorización de los prospectos de información al público inversionista no implica certificación sobre la bondad de las acciones que emitan o sobre la solvencia, liquidez, calidad crediticia o desempeño futuro de los fondos, ni de los Activos Objeto de Inversión que conforman su cartera.

Ningún intermediario financiero, apoderado para celebrar operaciones con el público, o cualquier otra persona, está autorizado para proporcionar información o hacer declaración alguna adicional al contenido del presente documento o el Prospecto de Información al Público Inversionista, por lo que deberán entenderse como no autorizados por el Fondo de Inversión.

Para mayor información, visite la página de internet de nuestra Sociedad Operadora y/o Distribuidoras, en donde podrá consultar el Prospecto de Información al Público Inversionista, así como la información actualizada sobre la cartera de inversiones del Fondo de Inversión.

El presente documento y el Prospecto de Información al Público Inversionista son los únicos documentos de venta que reconoce el Fondo de Inversión como válidos.

**Centro de Atención al Inversionista**

|                  |   |
|------------------|---|
| <b>Contacto:</b> | Centro de Contacto.                               |
| <b>Teléfono:</b> | 800 493 2000                                      |
| <b>Horario:</b>  | 08:30 a 18:00 horas, tiempo del centro de México. |

**Página(s) electrónica(s)**

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| <b>Operadora:</b>     | www.banorte.com/fondosdeinversion |
| <b>Distribuidora:</b> | www.banorte.com/fondosdeinversion |

**DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN**

Fondo Banorte 21, S.A. de C.V. F.I.I.D. administrado por Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, GFB

|                               |  |                                  |   |                                       |
|-------------------------------|--|----------------------------------|---|---------------------------------------|
| <b>Tipo:</b>                  | INSTRUMENTOS DE DEUDA  | <b>Serie B, Clase Accionaria</b> | <b>Posibles Adquirentes</b>   | <b>Monto Mínimo de Inversión (\$)</b> |
| <b>Categoría:</b>             | CORTO PLAZO MONEDA EXTRANJERA (IDCPME)                             | EMP                              | EMPLEADOS, DIRECTIVOS, CONSEJEROS O JUBILADOS DE GRUPO FINANCIERO BANORTE | Sin monto mínimo de inversión         |
| <b>Clave de Pizarra:</b>      | NTEEURO  |                                  |   |                                       |
| <b>Calificación:</b>          | AAAf/S5(mex)<br>Escala de calificación de Calificadora y homogénea |                                  |   |                                       |
| <b>Fecha de Autorización:</b> | 12 enero 2024 No. Oficio 157/026/2024                              |                                  |   |                                       |

**Importante:** El valor de un Fondo de Inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de Inversión**

El objetivo fundamental de NTEEURO será ofrecer un portafolio conformado primordialmente por activos objeto de inversión de deuda, Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda, Exchange Traded Funds (ETF'S) y/o Trackers denominados, indizados y/o referenciados al Euro, complementando la inversión con otros activos de deuda en moneda nacional. Dichos activos podrán estar emitidos en el mercado local o en mercados internacionales, de corto plazo principalmente, y de mediano y largo plazo en menor medida.

NTEEURO está orientado a pequeños, medianos y grandes inversionistas, personas físicas, personas morales, personas no sujetas a retención y/o Fondos de Inversión (considerando su nivel de complejidad o sofisticación) que busquen un nivel moderado a alto de riesgo y alta liquidez en función del objetivo, estrategia y calificación del Fondo.

El horizonte de inversión para el inversionista que compra acciones de NTEEURO es de corto plazo, por lo que se sugiere permanecer en el Fondo por lo menos un año para obtener los beneficios de la estrategia.

**Información Relevante**

Los Fondos de Inversión no cuentan con Asamblea de Accionistas, Consejo de Administración o Comisario:

- Las funciones de la Asamblea de Accionistas, así como las actividades del Consejo de Administración están encomendadas a Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte.
- La vigilancia del Fondo está asignada al Contralor Normativo de la Sociedad Operadora.

**Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos:** 2.58%, con un nivel de confianza del 95% a dos colas.

La pérdida máxima que en un escenario pesimista (3 en 100 veces) puede enfrentar el Fondo en un lapso de 1 día es de \$25.80 pesos por cada \$1,000 pesos invertidos. (Este dato es solo una estimación, y es válida únicamente en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

Se entiende por VaR a la pérdida máxima potencial en condiciones normales de mercado que pueden tener los activos netos de un Fondo de Inversión, calculada con un horizonte de tiempo de 1 día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones históricas en los factores de riesgo.

**Desempeño Histórico**

|                  |  |
|------------------|--|
| <b>Clase EMP</b> | <b>Índice de Referencia:</b> Tipo de Cambio del EURO (Valmer). |
|------------------|--|

**Tabla de Rendimientos nominales anualizados**

|                                 | Último Mes | Últimos 3 Meses | Últimos 12 Meses | Mes Rto. Bajo | Mes Rto. Alto |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|---------------|
| RENDIMIENTO BRUTO               | -29.24 %   | -16.65 %        | -8.48 %          | -46.09 %      | 52.17 %       |
| RENDIMIENTO NETO                | -29.77 %   | -17.27 %        | -9.15 %          | -46.47 %      | 51.09 %       |
| TASA LIBRE DE RIESGO (CETES 28) | 11.03 %    | 11.13 %         | 11.15 %          | 10.91 %       | 11.32 %       |
| ÍNDICE DE REFERENCIA            | -36.04 %   | -15.51 %        | -8.56 %          | -51.82 %      | 38.16 %       |

- El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.
- La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones o cualquier otro gasto.
- El desempeño del Fondo de Inversión en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá la inversión en el futuro.

**Régimen y Política de Inversión**

a) Estrategia de Inversión: Activa.

b) Montos máximos o mínimos de inversión de los principales activos objeto de inversión del Fondo:

|  | Mín | Máx  |
|--|-----|------|
| Activos objeto de inversión de deuda denominados, indizados y/o referenciados al Euro.   | 95% | 100% |
| Mecanismos de inversión colectiva ETFs denominados, indizados y/o referenciados al Euro. |     | 100% |
| Reportos.  |     | 100% |
| Valores de deuda en moneda nacional.   |     | 5%   |
| Valores de fácil realización y/o con vencimiento menor a 3 meses.                        | 20% | 100% |

c) Política de inversión: El Fondo podrá invertir en el mercado nacional y en mercados internacionales.

d) NTEEURO buscará proporcionar, antes de gastos totales e impuestos, un rendimiento similar al tipo de cambio del EURO. Este índice será dado a conocer en [www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio](http://www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio).

e) NTEEURO podrá invertir hasta un 100% de su activo neto en activos emitidos, avalados o aceptados por instituciones de crédito que formen parte del mismo Consorcio o Grupo empresarial al que pertenezca su Operadora de acuerdo al régimen de inversión, cumpliendo con lo establecido en el artículo 6 fracción I de la CUIFI.

f) NTEEURO podrá realizar operaciones de préstamo de valores, con un plazo máximo de 1 año, con prórrogas por igual periodo.

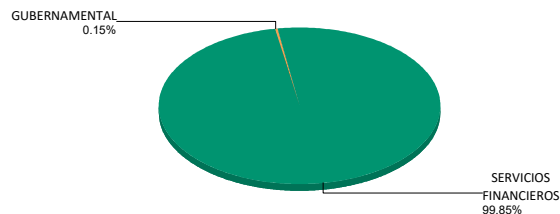
g) NTEEURO no invertirá en instrumentos financieros derivados, valores estructurados ni en valores respaldados por activos. NTEEURO podrá invertir en certificados bursátiles fiduciarios indizados, ETF's y/o en Trackers listados en el SIC y/o en otros mercados.

**Composición de la Cartera de Inversión**

Principales inversiones al mes de marzo 2024

| Clave de Pizarra     | Activo Objeto de Inversión |                   |          | Monto Miles de \$ | %           |
|----------------------|----------------------------|-------------------|----------|-------------------|-------------|
|                      | Emisora                    | Nombre/Subyacente | Tipo     |                   |             |
| 140-012 2742284      | Chequera Euros             | N/A               | CHEQUERA | 115,256           | 99.83%      |
| 2BPAG91 250102       | BONOS Prot Ahorro          | N/A               | REPORTO  | 178               | 0.15%       |
| 340-012 2742136      | Chequera Pesos             | N/A               | CHEQUERA | 15                | 0.01%       |
| 4                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 5                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 6                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 7                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 8                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 9                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 10                   |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| <b>Cartera Total</b> |                            |                   |          | <b>115,449</b>    | <b>100%</b> |

**Por Sector de Actividad Económica**



**Comisiones y Remuneraciones por la Prestación de Servicios**
**Pagadas por el cliente**

| Concepto                                   | Clase EMP  |            | Clase más representativa (F1) |            |
|--|------------|------------|-------------------------------|------------|
|  | %          | \$         | %                             | \$         |
| INCUMPLIMIENTO PLAZO MÍNIMO DE PERMANENCIA | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| INCUMPLIMIENTO SALDO MÍNIMO DE INVERSIÓN   | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| COMPRA DE ACCIONES                         | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| VENTA DE ACCIONES                          | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIOS POR ASESORÍA                     | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIO ADMINISTRACIÓN DE ACCIONES        | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| OTRAS                                      | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| <b>Total</b>                               | <b>n/a</b> | <b>n/a</b> | <b>n/a</b>                    | <b>n/a</b> |

No aplica para ninguna clase accionaria.

**Pagadas por el Fondo de Inversión**

(cifras correspondientes al mes de marzo 2024)

| Concepto                                | Clase EMP    |             | Clase más representativa (F1) |              |
|---|--------------|-------------|-------------------------------|--------------|
|   | %            | \$          | %                             | \$           |
| ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS               | 0.150        | 1.50        | 0.345                         | 3.45         |
| ADMINISTRACIÓN ACTIVOS S/ DESEMPEÑO     | n/a          | n/a         | n/a                           | n/a          |
| DISTRIBUCIÓN DE ACCIONES                | 0.350        | 3.50        | 0.805                         | 8.05         |
| VALUACIÓN DE ACCIONES                   | 0.043        | 0.43        | 0.043                         | 0.43         |
| DEPÓSITO DE ACCIONES DEL FI             | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| DEPÓSITO DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| CONTABILIDAD                            | 0.080        | 0.80        | 0.080                         | 0.80         |
| OTRAS                                   | 0.058        | 0.58        | 0.058                         | 0.58         |
| <b>Total</b>                            | <b>0.681</b> | <b>6.81</b> | <b>1.331</b>                  | <b>13.31</b> |

\*Porcentajes y cifras en pesos anualizados. Monto por cada \$1,000 pesos invertidos.

Otros incluye: proveedor de precios, calificadora, otros servicios administrativos, custodia, cuotas de CNBV, de Bolsas de Valores y de Auditoría Externa.

**Información sobre comisiones y remuneraciones**

Las comisiones por compra y venta de acciones pueden disminuir el monto total de su inversión. Esto implica que usted recibiría un monto menor después de una operación. Lo anterior, junto con las comisiones pagadas por el Fondo, representa una reducción del rendimiento total que recibiría por su inversión en el Fondo de Inversión.

Algunos prestadores de servicios pueden establecer acuerdos con el Fondo de Inversión y ofrecerle descuentos por sus servicios. Para conocer de su existencia y el posible beneficio para usted, pregunte con su distribuidor.

El Prospecto de Información al Público Inversionista contiene un mayor detalle de los conflictos de interés a los que pudiera estar sujeto cualquier prestador de servicios del Fondo de Inversión.

**Políticas para la compra - venta de acciones**

|                                     |                            |                             |  |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|--|
| <b>Plazo mínimo de permanencia:</b> | No tiene.                  | <b>Liquidez:</b>            | 48 horas (las solicitudes reciben todos los días hábiles).   |
| <b>Recepción de órdenes:</b>        | Todos los días hábiles.    | <b>Horario:</b>             | <b>Apertura:</b> 08:00 horas, tiempo del centro de México.<br><b>Cierre:</b> 10:30 horas, tiempo del centro de México. |
| <b>Ejecución de operaciones:</b>    | Mismo día de la recepción. | <b>Límites de recompra:</b> | Hasta el 10% del activo neto del Fondo.  |
| <b>Liquidación de operaciones:</b>  | 48 horas hábiles.          | <b>Diferencial*:</b>        | El Fondo no ha aplicado diferencial alguno en el precio de sus acciones.   |

\*El Fondo de Inversión, ante condiciones desordenadas de mercado u operaciones inusuales, podrá aplicar a las operaciones de compraventa de sus acciones, un diferencial sobre el precio actualizado de valuación de dichas acciones, que haya determinado previamente, y conservarlo a favor de los inversionistas que permanezcan en el Fondo de Inversión.

**Proveedores de Servicios**

|   |   |
|---|---|
| <b>Operadora:</b>                           | Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte. |
| <b>Distribuidora:</b>                       | Consultar Punto 2, inciso f) del Prospecto de Información.  |
| <b>Valuadora:</b>                           | GAF Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora Limitada de Fondos de Inversión.                                |
| <b>Institución Calificadora de Valores:</b> | Fitch México, S.A. de C.V.  |
| <b>Proveedor de Precios:</b>                | Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S.A. de C.V.  |

**Advertencias**

El Fondo de Inversión no cuenta con garantía alguna del Gobierno Federal, las entidades de la administración pública paraestatal, ni de la Sociedad Operadora ni del Grupo Financiero al que pertenece. La inversión en el Fondo de Inversión se encuentra respaldada hasta por el monto de su patrimonio.

La autorización de los prospectos de información al público inversionista no implica certificación sobre la bondad de las acciones que emitan o sobre la solvencia, liquidez, calidad crediticia o desempeño futuro de los fondos, ni de los Activos Objeto de Inversión que conforman su cartera.

Ningún intermediario financiero, apoderado para celebrar operaciones con el público, o cualquier otra persona, está autorizado para proporcionar información o hacer declaración alguna adicional al contenido del presente documento o el Prospecto de Información al Público Inversionista, por lo que deberán entenderse como no autorizados por el Fondo de Inversión.

Para mayor información, visite la página de internet de nuestra Sociedad Operadora y/o Distribuidoras, en donde podrá consultar el Prospecto de Información al Público Inversionista, así como la información actualizada sobre la cartera de inversiones del Fondo de Inversión.

El presente documento y el Prospecto de Información al Público Inversionista son los únicos documentos de venta que reconoce el Fondo de Inversión como válidos.

**Centro de Atención al Inversionista**

|                  |   |
|------------------|---|
| <b>Contacto:</b> | Centro de Contacto.                               |
| <b>Teléfono:</b> | 800 493 2000                                      |
| <b>Horario:</b>  | 08:30 a 18:00 horas, tiempo del centro de México. |

**Página(s) electrónica(s)**

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| <b>Operadora:</b>     | www.banorte.com/fondosdeinversion |
| <b>Distribuidora:</b> | www.banorte.com/fondosdeinversion |

**DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN**

Fondo Banorte 21, S.A. de C.V. F.I.I.D. administrado por Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, GFB

|                               |  |                                  |                                 |                                       |
|-------------------------------|--|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------------|
| <b>Tipo:</b>                  | INSTRUMENTOS DE DEUDA  | <b>Serie B, Clase Accionaria</b> | <b>Posibles Adquirentes</b>     | <b>Monto Mínimo de Inversión (\$)</b> |
| <b>Categoría:</b>             | CORTO PLAZO MONEDA EXTRANJERA (IDCPME)                             | E1                               | PERSONAS NO SUJETAS A RETENCIÓN | Sin monto mínimo de inversión         |
| <b>Clave de Pizarra:</b>      | NTEEURO  |                                  |                                 |                                       |
| <b>Calificación:</b>          | AAAf/S5(mex)<br>Escala de calificación de Calificadora y homogénea |                                  |                                 |                                       |
| <b>Fecha de Autorización:</b> | 12 enero 2024 No. Oficio 157/026/2024                              |                                  |                                 |                                       |

**Importante:** El valor de un Fondo de Inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de Inversión**

El objetivo fundamental de NTEEURO será ofrecer un portafolio conformado primordialmente por activos objeto de inversión de deuda, Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda, Exchange Traded Funds (ETF'S) y/o Trackers denominados, indizados y/o referenciados al Euro, complementando la inversión con otros activos de deuda en moneda nacional. Dichos activos podrán estar emitidos en el mercado local o en mercados internacionales, de corto plazo principalmente, y de mediano y largo plazo en menor medida.

NTEEURO está orientado a pequeños, medianos y grandes inversionistas, personas físicas, personas morales, personas no sujetas a retención y/o Fondos de Inversión (considerando su nivel de complejidad o sofisticación) que busquen un nivel moderado a alto de riesgo y alta liquidez en función del objetivo, estrategia y calificación del Fondo.

El horizonte de inversión para el inversionista que compra acciones de NTEEURO es de corto plazo, por lo que se sugiere permanecer en el Fondo por lo menos un año para obtener los beneficios de la estrategia.

**Información Relevante**

Los Fondos de Inversión no cuentan con Asamblea de Accionistas, Consejo de Administración o Comisario:

- Las funciones de la Asamblea de Accionistas, así como las actividades del Consejo de Administración están encomendadas a Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte.
- La vigilancia del Fondo está asignada al Contralor Normativo de la Sociedad Operadora.

**Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos:** 2.58%, con un nivel de confianza del 95% a dos colas.

La pérdida máxima que en un escenario pesimista (3 en 100 veces) puede enfrentar el Fondo en un lapso de 1 día es de \$25.80 pesos por cada \$1,000 pesos invertidos. (Este dato es solo una estimación, y es válida únicamente en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

Se entiende por VaR a la pérdida máxima potencial en condiciones normales de mercado que pueden tener los activos netos de un Fondo de Inversión, calculada con un horizonte de tiempo de 1 día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones históricas en los factores de riesgo.

**Desempeño Histórico**

|       |   |
|-------|---|
| Clase | Índice de Referencia: Tipo de Cambio del EURO (Valmer). |
| E1    |   |

**Tabla de Rendimientos nominales anualizados**

|                                 | Último Mes | Últimos 3 Meses | Últimos 12 Meses | Mes Rto. Bajo | Mes Rto. Alto |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|---------------|
| RENDIMIENTO BRUTO               | -29.24 %   | -16.65 %        | -5.28 %          | -47.43 %      | 56.20 %       |
| RENDIMIENTO NETO                | -29.77 %   | -17.27 %        | -5.61 %          | -47.43 %      | 55.39 %       |
| TASA LIBRE DE RIESGO (CETES 28) | 11.03 %    | 11.13 %         | 11.15 %          | 10.91 %       | 11.32 %       |
| ÍNDICE DE REFERENCIA            | -36.04 %   | -15.51 %        | -8.56 %          | -51.82 %      | 38.16 %       |

- El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.
- La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones o cualquier otro gasto.
- El desempeño del Fondo de Inversión en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá la inversión en el futuro.

**Régimen y Política de Inversión**

a) Estrategia de Inversión: Activa.

b) Montos máximos o mínimos de inversión de los principales activos objeto de inversión del Fondo:

|  | Mín | Máx  |
|--|-----|------|
| Activos objeto de inversión de deuda denominados, indizados y/o referenciados al Euro.   | 95% | 100% |
| Mecanismos de inversión colectiva ETFs denominados, indizados y/o referenciados al Euro. |     | 100% |
| Reportos.  |     | 100% |
| Valores de deuda en moneda nacional.   |     | 5%   |
| Valores de fácil realización y/o con vencimiento menor a 3 meses.                        | 20% | 100% |

c) Política de inversión: El Fondo podrá invertir en el mercado nacional y en mercados internacionales.

d) NTEEURO buscará proporcionar, antes de gastos totales e impuestos, un rendimiento similar al tipo de cambio del EURO. Este índice será dado a conocer en [www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio](http://www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio).

e) NTEEURO podrá invertir hasta un 100% de su activo neto en activos emitidos, avalados o aceptados por instituciones de crédito que formen parte del mismo Consorcio o Grupo empresarial al que pertenezca su Operadora de acuerdo al régimen de inversión, cumpliendo con lo establecido en el artículo 6 fracción I de la CUIFI.

f) NTEEURO podrá realizar operaciones de préstamo de valores, con un plazo máximo de 1 año, con prórrogas por igual periodo.

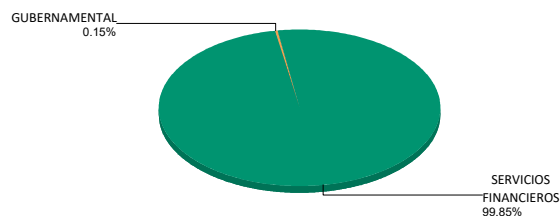
g) NTEEURO no invertirá en instrumentos financieros derivados, valores estructurados ni en valores respaldados por activos. NTEEURO podrá invertir en certificados bursátiles fiduciarios indizados, ETF's y/o en Trackers listados en el SIC y/o en otros mercados.

**Composición de la Cartera de Inversión**

Principales inversiones al mes de marzo 2024

| Clave de Pizarra     | Activo Objeto de Inversión |                   |          | Monto Miles de \$ | %           |
|----------------------|----------------------------|-------------------|----------|-------------------|-------------|
|                      | Emisora                    | Nombre/Subyacente | Tipo     |                   |             |
| 140-012 2742284      | Chequera Euros             | N/A               | CHEQUERA | 115,256           | 99.83%      |
| 2BPAG91 250102       | BONOS Prot Ahorro          | N/A               | REPORTO  | 178               | 0.15%       |
| 340-012 2742136      | Chequera Pesos             | N/A               | CHEQUERA | 15                | 0.01%       |
| 4                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 5                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 6                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 7                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 8                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 9                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 10                   |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| <b>Cartera Total</b> |                            |                   |          | <b>115,449</b>    | <b>100%</b> |

**Por Sector de Actividad Económica**



**Comisiones y Remuneraciones por la Prestación de Servicios**
**Pagadas por el cliente**

| Concepto                                   | Clase E1   |            | Clase más representativa (F1) |            |
|--|------------|------------|-------------------------------|------------|
|  | %          | \$         | %                             | \$         |
| INCUMPLIMIENTO PLAZO MÍNIMO DE PERMANENCIA | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| INCUMPLIMIENTO SALDO MÍNIMO DE INVERSIÓN   | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| COMPRA DE ACCIONES                         | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| VENTA DE ACCIONES                          | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIOS POR ASESORÍA                     | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIO ADMINISTRACIÓN DE ACCIONES        | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| OTRAS                                      | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| <b>Total</b>                               | <b>n/a</b> | <b>n/a</b> | <b>n/a</b>                    | <b>n/a</b> |

No aplica para ninguna clase accionaria.

**Pagadas por el Fondo de Inversión**

(cifras correspondientes al mes de marzo 2024)

| Concepto                                | Clase E1     |             | Clase más representativa (F1) |              |
|---|--------------|-------------|-------------------------------|--------------|
|   | %            | \$          | %                             | \$           |
| ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS               | 0.150        | 1.50        | 0.345                         | 3.45         |
| ADMINISTRACIÓN ACTIVOS S/ DESEMPEÑO     | n/a          | n/a         | n/a                           | n/a          |
| DISTRIBUCIÓN DE ACCIONES                | 0.350        | 3.50        | 0.805                         | 8.05         |
| VALUACIÓN DE ACCIONES                   | 0.043        | 0.43        | 0.043                         | 0.43         |
| DEPÓSITO DE ACCIONES DEL FI             | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| DEPÓSITO DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| CONTABILIDAD                            | 0.080        | 0.80        | 0.080                         | 0.80         |
| OTRAS                                   | 0.058        | 0.58        | 0.058                         | 0.58         |
| <b>Total</b>                            | <b>0.681</b> | <b>6.81</b> | <b>1.331</b>                  | <b>13.31</b> |

\*Porcentajes y cifras en pesos anualizados. Monto por cada \$1,000 pesos invertidos.

Otros incluye: proveedor de precios, calificadora, otros servicios administrativos, custodia, cuotas de CNBV, de Bolsas de Valores y de Auditoría Externa.

**Información sobre comisiones y remuneraciones**

Las comisiones por compra y venta de acciones pueden disminuir el monto total de su inversión. Esto implica que usted recibiría un monto menor después de una operación. Lo anterior, junto con las comisiones pagadas por el Fondo, representa una reducción del rendimiento total que recibiría por su inversión en el Fondo de Inversión.

Algunos prestadores de servicios pueden establecer acuerdos con el Fondo de Inversión y ofrecerle descuentos por sus servicios. Para conocer de su existencia y el posible beneficio para usted, pregunte con su distribuidor.

El Prospecto de Información al Público Inversionista contiene un mayor detalle de los conflictos de interés a los que pudiera estar sujeto cualquier prestador de servicios del Fondo de Inversión.

**Políticas para la compra - venta de acciones**

|                                     |                            |                             |  |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|--|
| <b>Plazo mínimo de permanencia:</b> | No tiene.                  | <b>Liquidez:</b>            | 48 horas (las solicitudes reciben todos los días hábiles).   |
| <b>Recepción de órdenes:</b>        | Todos los días hábiles.    | <b>Horario:</b>             | <b>Apertura:</b> 08:00 horas, tiempo del centro de México.<br><b>Cierre:</b> 10:30 horas, tiempo del centro de México. |
| <b>Ejecución de operaciones:</b>    | Mismo día de la recepción. | <b>Límites de recompra:</b> | Hasta el 10% del activo neto del Fondo.  |
| <b>Liquidación de operaciones:</b>  | 48 horas hábiles.          | <b>Diferencial*:</b>        | El Fondo no ha aplicado diferencial alguno en el precio de sus acciones.   |

\*El Fondo de Inversión, ante condiciones desordenadas de mercado u operaciones inusuales, podrá aplicar a las operaciones de compraventa de sus acciones, un diferencial sobre el precio actualizado de valuación de dichas acciones, que haya determinado previamente, y conservarlo a favor de los inversionistas que permanezcan en el Fondo de Inversión.

**Proveedores de Servicios**

|   |   |
|---|---|
| <b>Operadora:</b>                           | Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte. |
| <b>Distribuidora:</b>                       | Consultar Punto 2, inciso f) del Prospecto de Información.  |
| <b>Valuadora:</b>                           | GAF Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora Limitada de Fondos de Inversión.                                |
| <b>Institución Calificadora de Valores:</b> | Fitch México, S.A. de C.V.  |
| <b>Proveedor de Precios:</b>                | Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S.A. de C.V.  |

**Advertencias**

El Fondo de Inversión no cuenta con garantía alguna del Gobierno Federal, las entidades de la administración pública paraestatal, ni de la Sociedad Operadora ni del Grupo Financiero al que pertenece. La inversión en el Fondo de Inversión se encuentra respaldada hasta por el monto de su patrimonio.

La autorización de los prospectos de información al público inversionista no implica certificación sobre la bondad de las acciones que emitan o sobre la solvencia, liquidez, calidad crediticia o desempeño futuro de los fondos, ni de los Activos Objeto de Inversión que conforman su cartera.

Ningún intermediario financiero, apoderado para celebrar operaciones con el público, o cualquier otra persona, está autorizado para proporcionar información o hacer declaración alguna adicional al contenido del presente documento o el Prospecto de Información al Público Inversionista, por lo que deberán entenderse como no autorizados por el Fondo de Inversión.

Para mayor información, visite la página de internet de nuestra Sociedad Operadora y/o Distribuidoras, en donde podrá consultar el Prospecto de Información al Público Inversionista, así como la información actualizada sobre la cartera de inversiones del Fondo de Inversión.

El presente documento y el Prospecto de Información al Público Inversionista son los únicos documentos de venta que reconoce el Fondo de Inversión como válidos.

**Centro de Atención al Inversionista**

|                  |   |
|------------------|---|
| <b>Contacto:</b> | Centro de Contacto.                               |
| <b>Teléfono:</b> | 800 493 2000                                      |
| <b>Horario:</b>  | 08:30 a 18:00 horas, tiempo del centro de México. |

**Página(s) electrónica(s)**

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| <b>Operadora:</b>     | www.banorte.com/fondosdeinversion |
| <b>Distribuidora:</b> | www.banorte.com/fondosdeinversion |

**DOCUMENTO CON INFORMACIÓN CLAVE PARA LA INVERSIÓN**

Fondo Banorte 21, S.A. de C.V. F.I.I.D. administrado por Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, GFB

|                               |  |                                  |   |                                       |
|-------------------------------|--|----------------------------------|---|---------------------------------------|
| <b>Tipo:</b>                  | INSTRUMENTOS DE DEUDA  | <b>Serie B, Clase Accionaria</b> | <b>Posibles Adquirentes</b>   | <b>Monto Mínimo de Inversión (\$)</b> |
| <b>Categoría:</b>             | CORTO PLAZO MONEDA EXTRANJERA (IDCPME)                             | APIE                             | PERSONAS NO SUJETAS A RETENCIÓN (artículo 106 fracción IV, inciso b) de CUFÍ) | Sin monto mínimo de inversión         |
| <b>Clave de Pizarra:</b>      | NTEEURO  |                                  |   |                                       |
| <b>Calificación:</b>          | AAAf/S5(mex)<br>Escala de calificación de Calificadora y homogénea |                                  |   |                                       |
| <b>Fecha de Autorización:</b> | 12 enero 2024 No. Oficio 157/026/2024                              |                                  |   |                                       |

**Importante:** El valor de un Fondo de Inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeta a la fluctuación de los mercados, por lo que el inversionista puede obtener ganancias y pérdidas.

**Objetivo de Inversión**

El objetivo fundamental de NTEEURO será ofrecer un portafolio conformado primordialmente por activos objeto de inversión de deuda, Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda, Exchange Traded Funds (ETF'S) y/o Trackers denominados, indizados y/o referenciados al Euro, complementando la inversión con otros activos de deuda en moneda nacional. Dichos activos podrán estar emitidos en el mercado local o en mercados internacionales, de corto plazo principalmente, y de mediano y largo plazo en menor medida.

NTEEURO está orientado a pequeños, medianos y grandes inversionistas, personas físicas, personas morales, personas no sujetas a retención y/o Fondos de Inversión (considerando su nivel de complejidad o sofisticación) que busquen un nivel moderado a alto de riesgo y alta liquidez en función del objetivo, estrategia y calificación del Fondo.

El horizonte de inversión para el inversionista que compra acciones de NTEEURO es de corto plazo, por lo que se sugiere permanecer en el Fondo por lo menos un año para obtener los beneficios de la estrategia.

**Información Relevante**

Los Fondos de Inversión no cuentan con Asamblea de Accionistas, Consejo de Administración o Comisario:

- Las funciones de la Asamblea de Accionistas, así como las actividades del Consejo de Administración están encomendadas a Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte.
- La vigilancia del Fondo está asignada al Contralor Normativo de la Sociedad Operadora.

**Valor en riesgo (VaR) de la cartera de inversión respecto de sus activos netos:** 2.58%, con un nivel de confianza del 95% a dos colas.

La pérdida máxima que en un escenario pesimista (3 en 100 veces) puede enfrentar el Fondo en un lapso de 1 día es de \$25.80 pesos por cada \$1,000 pesos invertidos. (Este dato es solo una estimación, y es válida únicamente en condiciones normales de mercado, las expectativas de pérdida podrían ser mayores, incluso por el monto total de la inversión realizada).

Se entiende por VaR a la pérdida máxima potencial en condiciones normales de mercado que pueden tener los activos netos de un Fondo de Inversión, calculada con un horizonte de tiempo de 1 día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones históricas en los factores de riesgo.

**Desempeño Histórico**

|               |  |
|---------------|--|
| Clase<br>APIE | <b>Índice de Referencia:</b> Tipo de Cambio del EURO (Valmer). |
|---------------|--|

**Tabla de Rendimientos nominales anualizados**

|                                 | Último Mes | Últimos 3 Meses | Últimos 12 Meses | Mes Rto. Bajo | Mes Rto. Alto |
|---------------------------------|------------|-----------------|------------------|---------------|---------------|
| RENDIMIENTO BRUTO               | -22.31 %   | -4.28 %         | -1.08 %          | -41.00 %      | 67.57 %       |
| RENDIMIENTO NETO                | -22.31 %   | -4.28 %         | -1.08 %          | -41.00 %      | 67.57 %       |
| TASA LIBRE DE RIESGO (CETES 28) | 11.03 %    | 11.13 %         | 11.15 %          | 10.91 %       | 11.32 %       |
| ÍNDICE DE REFERENCIA            | -36.04 %   | -15.51 %        | -8.56 %          | -51.82 %      | 38.16 %       |

- El rendimiento neto es después de comisiones y el que obtuvo el inversionista en el periodo.
- La tasa libre de riesgo es una tasa que no incluye descuentos por comisiones o cualquier otro gasto.
- El desempeño del Fondo de Inversión en el pasado, no necesariamente es indicativo del desempeño que tendrá la inversión en el futuro.

**Régimen y Política de Inversión**

a) Estrategia de Inversión: Activa.

b) Montos máximos o mínimos de inversión de los principales activos objeto de inversión del Fondo:

|  | Mín | Máx  |
|--|-----|------|
| Activos objeto de inversión de deuda denominados, indizados y/o referenciados al Euro.   | 95% | 100% |
| Mecanismos de inversión colectiva ETFs denominados, indizados y/o referenciados al Euro. |     | 100% |
| Reportos.  |     | 100% |
| Valores de deuda en moneda nacional.   |     | 5%   |
| Valores de fácil realización y/o con vencimiento menor a 3 meses.                        | 20% | 100% |

c) Política de inversión: El Fondo podrá invertir en el mercado nacional y en mercados internacionales.

d) NTEEURO buscará proporcionar, antes de gastos totales e impuestos, un rendimiento similar al tipo de cambio del EURO. Este índice será dado a conocer en [www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio](http://www.valmer.com/es/valmer/tiposdecambio).

e) NTEEURO podrá invertir hasta un 100% de su activo neto en activos emitidos, avalados o aceptados por instituciones de crédito que formen parte del mismo Consorcio o Grupo empresarial al que pertenezca su Operadora de acuerdo al régimen de inversión, cumpliendo con lo establecido en el artículo 6 fracción I de la CUFÍ.

f) NTEEURO podrá realizar operaciones de préstamo de valores, con un plazo máximo de 1 año, con prórrogas por igual periodo.

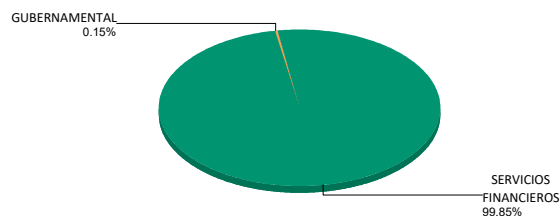
g) NTEEURO no invertirá en instrumentos financieros derivados, valores estructurados ni en valores respaldados por activos. NTEEURO podrá invertir en certificados bursátiles fiduciarios indizados, ETF's y/o en Trackers listados en el SIC y/o en otros mercados.

**Composición de la Cartera de Inversión**

Principales inversiones al mes de marzo 2024

| Clave de Pizarra     | Activo Objeto de Inversión |                   |          | Monto Miles de \$ | %           |
|----------------------|----------------------------|-------------------|----------|-------------------|-------------|
|                      | Emisora                    | Nombre/Subyacente | Tipo     |                   |             |
| 140-012 2742284      | Chequera Euros             | N/A               | CHEQUERA | 115,256           | 99.83%      |
| 2BPAG91 250102       | BONOS Prot Ahorro          | N/A               | REPORTO  | 178               | 0.15%       |
| 340-012 2742136      | Chequera Pesos             | N/A               | CHEQUERA | 15                | 0.01%       |
| 4                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 5                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 6                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 7                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 8                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 9                    |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| 10                   |                            |                   | -        | 0                 | 0.00%       |
| <b>Cartera Total</b> |                            |                   |          | <b>115,449</b>    | <b>100%</b> |

**Por Sector de Actividad Económica**



**Comisiones y Remuneraciones por la Prestación de Servicios**
**Pagadas por el cliente**

| Concepto                                   | Clase APIE |            | Clase más representativa (F1) |            |
|--|------------|------------|-------------------------------|------------|
|  | %          | \$         | %                             | \$         |
| INCUMPLIMIENTO PLAZO MÍNIMO DE PERMANENCIA | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| INCUMPLIMIENTO SALDO MÍNIMO DE INVERSIÓN   | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| COMPRA DE ACCIONES                         | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| VENTA DE ACCIONES                          | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIOS POR ASESORÍA                     | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| SERVICIO ADMINISTRACIÓN DE ACCIONES        | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| OTRAS                                      | n/a        | n/a        | n/a                           | n/a        |
| <b>Total</b>                               | <b>n/a</b> | <b>n/a</b> | <b>n/a</b>                    | <b>n/a</b> |

No aplica para ninguna clase accionaria.

**Pagadas por el Fondo de Inversión**

(cifras correspondientes al mes de marzo 2024)

| Concepto                                | Clase APIE   |             | Clase más representativa (F1) |              |
|---|--------------|-------------|-------------------------------|--------------|
|   | %            | \$          | %                             | \$           |
| ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS               | 0.000        | 0.00        | 0.345                         | 3.45         |
| ADMINISTRACIÓN ACTIVOS S/ DESEMPEÑO     | n/a          | n/a         | n/a                           | n/a          |
| DISTRIBUCIÓN DE ACCIONES                | 0.000        | 0.00        | 0.805                         | 8.05         |
| VALUACIÓN DE ACCIONES                   | 0.000        | 0.00        | 0.043                         | 0.43         |
| DEPÓSITO DE ACCIONES DEL FI             | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| DEPÓSITO DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN | 0.000        | 0.00        | 0.000                         | 0.00         |
| CONTABILIDAD                            | 0.000        | 0.00        | 0.080                         | 0.80         |
| OTRAS                                   | 0.000        | 0.00        | 0.058                         | 0.58         |
| <b>Total</b>                            | <b>0.000</b> | <b>0.00</b> | <b>1.331</b>                  | <b>13.31</b> |

\*Porcentajes y cifras en pesos anualizados. Monto por cada \$1,000 pesos invertidos.

Otros incluye: proveedor de precios, calificadora, otros servicios administrativos, custodia, cuotas de CNBV, de Bolsas de Valores y de Auditoría Externa.

**Información sobre comisiones y remuneraciones**

Las comisiones por compra y venta de acciones pueden disminuir el monto total de su inversión. Esto implica que usted recibiría un monto menor después de una operación. Lo anterior, junto con las comisiones pagadas por el Fondo, representa una reducción del rendimiento total que recibiría por su inversión en el Fondo de Inversión.

Algunos prestadores de servicios pueden establecer acuerdos con el Fondo de Inversión y ofrecerle descuentos por sus servicios. Para conocer de su existencia y el posible beneficio para usted, pregunte con su distribuidor.

El Prospecto de Información al Público Inversionista contiene un mayor detalle de los conflictos de interés a los que pudiera estar sujeto cualquier prestador de servicios del Fondo de Inversión.

**Políticas para la compra - venta de acciones**

|                                     |                            |                             |  |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|--|
| <b>Plazo mínimo de permanencia:</b> | No tiene.                  | <b>Liquidez:</b>            | 48 horas (las solicitudes reciben todos los días hábiles).   |
| <b>Recepción de órdenes:</b>        | Todos los días hábiles.    | <b>Horario:</b>             | <b>Apertura:</b> 08:00 horas, tiempo del centro de México.<br><b>Cierre:</b> 10:30 horas, tiempo del centro de México. |
| <b>Ejecución de operaciones:</b>    | Mismo día de la recepción. | <b>Límites de recompra:</b> | Hasta el 10% del activo neto del Fondo.  |
| <b>Liquidación de operaciones:</b>  | 48 horas hábiles.          | <b>Diferencial*:</b>        | El Fondo no ha aplicado diferencial alguno en el precio de sus acciones.   |

\*El Fondo de Inversión, ante condiciones desordenadas de mercado u operaciones inusuales, podrá aplicar a las operaciones de compraventa de sus acciones, un diferencial sobre el precio actualizado de valuación de dichas acciones, que haya determinado previamente, y conservarlo a favor de los inversionistas que permanezcan en el Fondo de Inversión.

**Prestadores de Servicios**

|   |   |
|---|---|
| <b>Operadora:</b>                           | Operadora de Fondos Banorte, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión, Grupo Financiero Banorte. |
| <b>Distribuidora:</b>                       | Consultar Punto 2, inciso f) del Prospecto de Información.  |
| <b>Valuadora:</b>                           | GAF Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora Limitada de Fondos de Inversión.                                |
| <b>Institución Calificadora de Valores:</b> | Fitch México, S.A. de C.V.  |
| <b>Proveedor de Precios:</b>                | Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S.A. de C.V.  |

**Advertencias**

El Fondo de Inversión no cuenta con garantía alguna del Gobierno Federal, las entidades de la administración pública paraestatal, ni de la Sociedad Operadora ni del Grupo Financiero al que pertenece. La inversión en el Fondo de Inversión se encuentra respaldada hasta por el monto de su patrimonio.

La autorización de los prospectos de información al público inversionista no implica certificación sobre la bondad de las acciones que emitan o sobre la solvencia, liquidez, calidad crediticia o desempeño futuro de los fondos, ni de los Activos Objeto de Inversión que conforman su cartera.

Ningún intermediario financiero, apoderado para celebrar operaciones con el público, o cualquier otra persona, está autorizado para proporcionar información o hacer declaración alguna adicional al contenido del presente documento o el Prospecto de Información al Público Inversionista, por lo que deberán entenderse como no autorizados por el Fondo de Inversión.

Para mayor información, visite la página de internet de nuestra Sociedad Operadora y/o Distribuidoras, en donde podrá consultar el Prospecto de Información al Público Inversionista, así como la información actualizada sobre la cartera de inversiones del Fondo de Inversión.

El presente documento y el Prospecto de Información al Público Inversionista son los únicos documentos de venta que reconoce el Fondo de Inversión como válidos.

**Centro de Atención al Inversionista**

|                  |   |
|------------------|---|
| <b>Contacto:</b> | Centro de Contacto.                               |
| <b>Teléfono:</b> | 800 493 2000                                      |
| <b>Horario:</b>  | 08:30 a 18:00 horas, tiempo del centro de México. |

**Página(s) electrónica(s)**

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| <b>Operadora:</b>     | www.banorte.com/fondosdeinversion |
| <b>Distribuidora:</b> | www.banorte.com/fondosdeinversion |